

诺安主题精选混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
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	13
§ 5	托管人报告	13
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	17
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12	投资组合报告附注	47
§ 8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9	开放式基金份额变动	48
§ 10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安主题精选混合型证券投资基金
基金简称	诺安主题精选混合
基金主代码	320012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 09 月 15 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	140,429,918.02 份
基金合同存续期	不定期

注：自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安主题精选股票型证券投资基金”变更为“诺安主题精选混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选主题，稳健投资，力图在不同的市场环境下均可突破局限，在长期内获得超过比较基准的超额收益。
投资策略	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略五部分组成。</p> <p>1. 资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2. 股票投资策略方面，本基金的股票投资策略由构建备选主题库、筛选主题、精选个股和构建组合四个步骤组成。</p> <p>3. 存托凭证投资策略方面，本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4. 债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>5. 权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	75%沪深 300 指数+25%中证全债指数
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	-10,270,043.51
本期利润	-39,017,259.74
加权平均基金份额本期利润	-0.3165
本期加权平均净值利润率	-10.63%
本期基金份额净值增长率	-9.04%
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	249,541,227.90
期末可供分配基金份额利润	1.7770
期末基金资产净值	389,971,145.92
期末基金份额净值	2.777
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	204.74%

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	0.51%	0.72%	1.02%	0.65%	-0.51%	0.07%
过去三个月	-7.68%	0.71%	-3.37%	0.62%	-4.31%	0.09%
过去六个月	-9.04%	0.93%	0.25%	0.63%	-9.29%	0.30%
过去一年	-10.82%	1.23%	-9.74%	0.74%	-1.08%	0.49%
过去三年	-16.46%	1.41%	-1.92%	0.90%	-14.54%	0.51%
自基金合同生效起至今	204.74%	1.36%	47.43%	1.05%	157.31%	0.31%

注：本基金的业绩比较基准为：75%沪深 300 指数+25%中证全债指数。

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		
罗春蕾	本基金基金经理	2015年09月26日	-	16年	硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银华基金管理有限公司，从事医药行业研究工作。2011年12月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2019年2月至2020年4月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年5月任诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金经理。2015年9月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任诺安积极配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 上半年，A 股市场的分化非常明显。中证 1000、中证 500、科创 50 等以中小市值公司为主的指数涨幅居前，达 2%-5%；且以大股票为主的上证综指也上涨约 3.65%。另一方面，创业板指、上证 50 等指数则下跌超过 5%。从细分行业看，通信、传媒、计算机等 TMT 行业指数涨幅高达 30-45%，建筑、石油石化等央企国企较多的行业涨幅也超过 10%。与此同时，除了家电和纺服，几乎所有的大消费及医药板块都是下跌的，其中社服行业跌幅高达 27%。可以说，2023 上半年是过去几年中行情分化最为明显的一段时间。

之所以 A 股有如此表现，我们认为与几点有关：一、宏观经济的弱势逐步得到印证。从 2022 年

末防疫突然放松至 2023 上半年，市场对经济预期持续下调，从根据欧美及亚洲各国经验看会有较强复苏，疫情积压需求释放后的弱复苏，地产数据不佳、年轻人就业不理想、企业家信心不足、制造业中长期投资动力不强、居民消费意愿疲弱等因素导致的微弱复苏。虽然疫情之后各行各业都在逐渐回到经营正轨，但从 CPI、PPI、库存等数据看，国内经济仍处于降价去库存阶段（少数提前去库存的行业除外，比如白电中的空调），企业利润并不理想。二、在宏观经济较弱的局面之下，政府并未有强力提振经济的政策出台。此前市场一直预期疫情后如果经济恢复不理想，政府可能有地产放松、刺激消费、基建财政加码等政策出台。但实际上，政府对地产“房住不炒”定力非常强，对经济刺激政策也相对谨慎，令市场对政策出台的预期从强到弱，甚至到基本没有预期了。因此在二季度与经济复苏相关性较强的大消费、医药、地产建材等板块走势低迷。三、ChatGPT 等科技产业热点不断发酵。ChatGPT 自从今年二月份引发市场关注之后就一路走强，行情初期市场对 AI 大模型的认知有限，与之相关的个股多点开花，主题炒作风格明显。进入二季度，随着 AI 的产业趋势日益清晰，科技巨头们对 AI 的投入也越来越多，产业链里受益的公司（或者说方向）也逐渐明朗了，市场热情更集中在算力、下游应用、训练内容资源等几个方向上，相关个股涨幅巨大。一面是 AI 这种巨大的赚钱效应，一面是不断低于预期的宏观经济，ChatGPT 的行情不仅自己光芒四射，更从其他板块大幅抽水，导致二季度市场风格的明显分化。四、2022 年底监管层多次提到的有“中国特色估值体系”的央企国企，相比于其他行业而言，估值便宜且分红收益率高，在今天的宏观背景之下也成为市场的主要偏好之一。

虽然今年上半年 AI 行情精彩纷呈，但是本基金的投资方向始终坚守在大消费与医药赛道，未曾有变。我们之前认为在 2023 年宏观经济复苏的背景下（无论是强复苏还是弱复苏），不同行业的复苏态势可能有所差异，但相较之下，消费和医药的复苏是相对比较确定（基于内需）和较强的（场景修复弹性大），因此也将会是 A 股比较好的投资机会。但目前来看，实际的经济态势和 A 股表现与我们的预期差异较大。首先，在内需和出口这两方面，我们之前认为 2023 年内需旺而出口弱，但这半年观察下来，美欧市场的需求刚性比我们想象的强，出口链相关的公司业绩也多有超预期；反而内需因为前文提到的种种因素反而比我们想象的弱。在市场行情上，大消费因基本面较弱、甚至中期展望不佳（企业和消费者信心都不足）而股价疲软，AI 主题则因想象空间巨大而气势如虹，因此本基金的净值表现不理想，也低于我们自己的预期。

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 2.777 元，本报告期内基金份额净值增长率为-9.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

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 2023 年下半年，我们认为虽然经济复苏的节奏与我们此前预判有差异，但是宏观改善、消费复苏的大方向并未有错，且这一趋势有望在中美周期共同见底之后再次变强。因此我们对大消费及医药中长期看好的观点并未改变，且依然会在行情低谷期间不断寻找优质公司为日后的上涨做准备。

在 2023 年下半年，我们认为上半年那种极端分化的行情可能会发生变化。原因有几点：

一、政策转向在即。进入七月份，监管层在中央经济工作会议里首次不提“房住不炒”，预计各地陆续将有具体的地产放松政策出台。虽然这一轮的地产政策力度无法与棚改相比，但对于当下低迷的地产销售、开工、拿地等仍然会有帮助。

二、大部分的消费及医药板块是从 2021 年中期开始调整的，至今回调已有两年之久，不少个股的股价已处于历史低位。经济复苏的节奏虽慢，但随着地产数据的见底，就业、消费的回暖也会到来，基本面的改善会传导到股价上。

三、中美之间高层领导的接触在 2022 年 11 月份的“气球事件”之后一度中断，而在 2023 年布林肯访华之后重启，接下来一段时间或将是中美关系相对缓和期，这将改善资本市场的风险偏好。

总之进入 2023 年下半年，经济基本面、市场风险偏好、流动性有望比上半年有所改善，而前期跌幅较多的大消费及医药板块也会受益于此。

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

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，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

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	37,385,362.87	32,950,601.49
结算备付金		264,790.45	509,049.01
存出保证金		123,071.18	105,925.89
交易性金融资产	6.4.7.2	327,524,599.40	323,651,820.27

其中：股票投资		327,524,599.40	323,651,820.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-10,386.85	-
应收清算款		26,721,487.88	1,634,204.32
应收股利		-	-
应收申购款		62,063.90	119,062.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		392,070,988.83	358,970,663.20
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		568,139.23	-
应付赎回款		399,400.70	1,394,460.84
应付管理人报酬		483,752.26	452,273.46
应付托管费		80,625.38	75,378.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	567,925.34	486,474.71
负债合计		2,099,842.91	2,408,587.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	140,429,918.02	116,779,938.67
未分配利润	6.4.7.8	249,541,227.90	239,782,136.63
净资产合计		389,971,145.92	356,562,075.30
负债和净资产总计		392,070,988.83	358,970,663.20

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.777 元，基金份额总额 140,429,918.02 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

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		-35,745,302.81	-33,896,316.57
1. 利息收入		103,137.01	113,152.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	97,943.58	109,431.77
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		5,193.43	3,720.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,198,988.64	-47,694,797.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,501,253.51	-49,471,577.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,302,264.87	1,776,780.85
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	-28,747,216.23	13,610,207.93
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	97,765.05	75,120.16
减：二、营业总支出		3,271,956.93	2,726,187.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,732,741.06	2,265,452.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	455,456.85	377,575.54
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	83,759.02	83,158.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-39,017,259.74	-36,622,503.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-39,017,259.74	-36,622,503.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-39,017,259.74	-36,622,503.82

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

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）	116,779,938.67	-	239,782,136.63	356,562,075.30
二、本期期初净资产（基金净值）	116,779,938.67	-	239,782,136.63	356,562,075.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,649,979.35	-	9,759,091.27	33,409,070.62
（一）、综合收益总额	-	-	-39,017,259.74	-39,017,259.74
（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）	23,649,979.35	-	48,776,351.01	72,426,330.36
其中：1. 基金申购款	52,359,530.96	-	107,832,792.55	160,192,323.51
2. 基金赎回款	-28,709,551.61	-	-59,056,441.54	-87,765,993.15
（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）	140,429,918.02	-	249,541,227.90	389,971,145.92
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）	106,073,467.08	-	265,074,276.81	371,147,743.89
二、本期期初净资产（基金净值）	106,073,467.08	-	265,074,276.81	371,147,743.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,727,622.62	-	-11,775,481.71	1,952,140.91
（一）、综合收益总额	-	-	-36,622,503.82	-36,622,503.82
（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）	13,727,622.62	-	24,847,022.11	38,574,644.73
其中：1. 基金申购款	36,220,137.08	-	69,108,107.99	105,328,245.07
2. 基金赎回款	-22,492,514.46	-	-44,261,085.88	-66,753,600.34
（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）	119,801,089.70	-	253,298,795.10	373,099,884.80

值)				
----	--	--	--	--

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：

<u>齐斌</u>	<u>田冲</u>	<u>何柳姿</u>
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

诺安主题精选混合型证券投资基金(简称“本基金”)原名为诺安主题精选股票型证券投资基金。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会第 104 号)规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自 2015 年 8 月 6 日起,诺安主题精选股票型证券投资基金名称变更为诺安主题精选混合型证券投资基金。原诺安主题精选股票型证券投资基金经中国证监会《关于核准诺安主题精选股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2010〕984 号)批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安主题精选股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2010 年 9 月 15 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 3,309,251,362.03 份基金份额,其中认购资金利息折合 189,075.35 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安主题精选混合型证券投资基金基金合同》和《诺安主题精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含创业板股票)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票、存托凭证等权益类资产占基金资产的 60%-95%,其中不低于 80%的股票、存托凭证资产投资于与基金管理人构建的备选主题库相关联的个股;债券等固定收益类资产占基金资产的 0%-40%;权证占基金资产净值的 0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定等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；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。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。自2008年10月9日起，暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日	
	活期存款	37,385,362.87
等于：本金	37,380,061.15	
加：应计利息	5,301.72	
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	37,385,362.87	

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	341,048,667.01	-	327,524,599.40	-13,524,067.61
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	341,048,667.01	-	327,524,599.40	-13,524,067.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-10,386.85	-
银行间市场	-	-
合计	-10,386.85	-

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	473.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	485,629.46
其中：交易所市场	485,629.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	567,925.34

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	116,779,938.67	116,779,938.67
本期申购	52,359,530.96	52,359,530.96
本期赎回（以“-”号填列）	-28,709,551.61	-28,709,551.61
本期末	140,429,918.02	140,429,918.02

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	290,108,112.69	-50,325,976.06	239,782,136.63
本期利润	-10,270,043.51	-28,747,216.23	-39,017,259.74
本期基金份额交易产生的变动数	62,461,114.35	-13,684,763.34	48,776,351.01
其中：基金申购款	134,413,344.10	-26,580,551.55	107,832,792.55
基金赎回款	-71,952,229.75	12,895,788.21	-59,056,441.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	342,299,183.53	-92,757,955.63	249,541,227.90

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	92,149.89
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	4,809.48
其他	984.21
合计	97,943.58

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	455,613,471.33
减：卖出股票成本总额	463,728,541.44
减：交易费用	1,386,183.40
买卖股票差价收入	-9,501,253.51

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 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	2,302,264.87
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	2,302,264.87

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	-28,747,216.23
-- 股票投资	-28,747,216.23
-- 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	-28,747,216.23

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	52,799.41
基金转换费收入	44,965.64
合计	97,765.05

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	1,936.16
合计	83,759.02

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
中国建设银行股份有限公司	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	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
当期发生的基金应支付的管理费	2,732,741.06	2,265,452.91
其中：支付销售机构的客户维护费	886,034.74	801,353.18

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	455,456.85	377,575.54

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司-活期存款	37,385,362.87	92,149.89	71,554,709.42	103,648.70

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

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
00128	三联	2023年	6个月	新股锁	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

2	锻造	05月15日		定							
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	429	5,096.52	9,017.58	-	
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	127	2,626.36	3,237.23	-	
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	210	9,687.30	7,224.00	-	

		日								
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	248	14,354.24	12,194.16	-
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	379	18,950.00	11,639.09	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	591	18,232.35	13,965.33	-
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	485	14,656.70	12,367.50	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.54	25.10	290	9,145.26	7,279.00	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	476	18,149.88	14,770.28	-
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	316	9,353.60	22,568.72	-
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	2,770	13,850.00	24,819.20	-
301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	550	14,740.00	12,276.00	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	481	12,145.25	9,470.89	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	422	13,647.48	13,444.92	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	294	19,780.32	19,236.42	-
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	87.11	53.24	149	12,979.89	7,932.76	-
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	182	13,977.60	19,646.90	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	702	10,396.62	9,638.46	-
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	116	8,520.20	5,410.24	-
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	-
301355	北方	2023年	6个月	新股锁	50.00	48.39	181	9,050.00	8,758.59	-

7	长龙	04月11日		定							
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	371	8,818.67	15,912.19	-	
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	273	9,208.29	8,695.05	-	
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	376	8,948.80	12,347.84	-	
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	354	10,616.46	8,421.66	-	
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	258	15,046.56	11,702.88	-	
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	253	13,477.31	10,170.60	-	
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	261	11,481.39	13,459.77	-	
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	752	12,212.48	12,746.40	-	
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	443	8,855.57	7,486.70	-
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	2,326	134,117.16	134,117.16	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	259	14,933.94	14,933.94	-
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	1,005	6,612.90	7,617.90	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	345	3,574.20	4,084.80	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	310	3,614.60	3,800.60	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	102	2,649.96	2,502.06	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	337	5,998.60	6,028.93	-
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	315	11,387.25	12,010.95	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	1,790	35,549.40	32,327.40	-

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	730	10,336.80	11,833.30	-
688343	云天励飞	2023年03月28日	6个月	新股锁定	43.92	50.67	4,742	208,268.64	240,277.14	-
688352	顾中科技	2023年04月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	902	10,914.20	10,887.14	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	319	7,528.40	20,629.73	-
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	257	6,851.62	8,095.50	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	127	9,525.00	11,526.52	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	3,229	18,373.01	17,468.89	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	1,600	17,760.00	27,264.00	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	354	11,512.08	14,998.98	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	233	7,919.67	6,871.17	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	293	11,717.07	10,756.03	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	164.83	122.11	73	12,032.44	8,914.03	-
68851	慧智	2023年	6个月	新股锁	20.92	19.16	505	10,564.60	9,675.80	-

2	微	05月08日		定							
688523	航天环宇	2023年05月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688531	日联科技	2023年03月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	110	16,761.80	14,956.70	-	
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	260	11,354.20	13,793.00	-	
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	471	9,971.07	11,068.50	-	
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	653	8,280.04	14,568.43	-	
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	408	12,346.08	10,334.64	-	
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	78	9,812.40	9,206.34	-	
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	420	11,230.80	17,085.60	-	
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	111	13,972.68	9,633.69	-	

		日								
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	-
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	300	7,584.00	8,961.00	-

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。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息

系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计

息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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低于 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	37,385,362.87	-	-	-	-	37,385,362.87
结算备付金	264,790.45	-	-	-	-	264,790.45
存出保证金	123,071.18	-	-	-	-	123,071.18
交易性金融资产	-	-	-	-	327,524,599.40	327,524,599.40
买入返售金融资产	-10,386.85	-	-	-	-	-10,386.85
应收清算款	-	-	-	-	26,721,487.88	26,721,487.88
应收申购款	-	-	-	-	62,063.90	62,063.90
资产总计	37,762,837.65	-	-	-	354,308,151.18	392,070,988.83
负债						
应付清算款	-	-	-	-	568,139.23	568,139.23
应付赎回款	-	-	-	-	399,400.70	399,400.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	483,752.26	483,752.26
应付托管费	-	-	-	-	80,625.38	80,625.38
其他负债	-	-	-	-	567,925.34	567,925.34
负债总计	-	-	-	-	2,099,842.91	2,099,842.91
利率敏感度缺口	37,762,837.65	-	-	-	-352,208,308.27	389,971,145.92
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	32,950,601.49	-	-	-	-	32,950,601.49

结算备付金	509,049.01	-	-	-	-	509,049.01
存出保证金	105,925.89	-	-	-	-	105,925.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-323,651,820.27	323,651,820.27
应收清算款	-	-	-	-	1,634,204.32	1,634,204.32
应收申购款	370.00	-	-	-	118,692.22	119,062.22
资产总计	33,565,946.39	-	-	-	-325,404,716.81	358,970,663.20
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,394,460.84	1,394,460.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	452,273.46	452,273.46
应付托管费	-	-	-	-	75,378.89	75,378.89
其他负债	-	-	-	-	486,474.71	486,474.71
负债总计	-	-	-	-	2,408,587.90	2,408,587.90
利率敏感度缺口	33,565,946.39	-	-	-	-322,996,128.91	356,562,075.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	327,524,599.40	83.99	323,651,820.27	90.77
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	327,524,599.40	83.99	323,651,820.27	90.77

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%	13,023,501.03	19,202,727.66
	业绩比较基准下降5%	-13,023,501.03	-19,202,727.66

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	325,506,200.32	322,475,775.74
第二层次	736,564.08	-
第三层次	1,281,835.00	1,176,044.53
合计	327,524,599.40	323,651,820.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其剩余期限较短，账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	327,524,599.40	83.54
	其中：股票	327,524,599.40	83.54
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	-10,386.85	0.00
	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	37,650,153.32	9.60
8	其他各项资产	26,906,622.96	6.86
9	合计	392,070,988.83	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	288,400,164.71	73.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	6,176.11	0.00
F	批发和零售业	38,836.08	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	15,897,000.00	4.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	329,913.47	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,135,100.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	11,833.30	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	16,694.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,653,433.37	3.76
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	327,524,599.40	83.99

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	600276	恒瑞医药	530,000	25,387,000.00	6.51
2	688198	佰仁医疗	180,081	19,108,394.91	4.90
3	300896	爱美客	40,000	17,798,000.00	4.56
4	600009	上海机场	350,000	15,897,000.00	4.08
5	688050	爱博医疗	77,000	15,810,410.00	4.05
6	301267	华夏眼科	240,047	14,630,864.65	3.75
7	603486	科沃斯	180,000	13,998,600.00	3.59
8	001215	千味央厨	210,000	13,962,900.00	3.58
9	688169	石头科技	42,034	13,479,463.12	3.46
10	002422	科伦药业	430,000	12,762,400.00	3.27

11	001322	箭牌家居	750,056	12,555,937.44	3.22
12	002790	瑞尔特	1,300,000	12,480,000.00	3.20
13	688085	三友医疗	470,092	12,344,615.92	3.17
14	688114	华大智造	140,040	12,121,862.40	3.11
15	000333	美的集团	200,000	11,784,000.00	3.02
16	688126	沪硅产业	400,000	8,360,000.00	2.14
17	300662	科锐国际	230,000	8,135,100.00	2.09
18	000651	格力电器	220,600	8,054,106.00	2.07
19	688617	惠泰医疗	20,052	7,494,435.00	1.92
20	603027	千禾味业	350,024	7,392,506.88	1.90
21	603345	安井食品	50,000	7,340,000.00	1.88
22	300957	贝泰妮	80,000	7,110,400.00	1.82
23	603170	宝立食品	250,042	5,315,892.92	1.36
24	300633	开立医疗	90,000	4,905,000.00	1.26
25	688520	神州细胞	80,037	4,541,299.38	1.16
26	601865	福莱特	114,200	4,397,842.00	1.13
27	688223	晶科能源	306,433	4,308,447.98	1.10
28	002459	晶澳科技	100,000	4,170,000.00	1.07
29	688212	澳华内镜	60,004	4,074,271.60	1.04
30	600161	天坛生物	148,400	4,029,060.00	1.03
31	600150	中国船舶	118,400	3,896,544.00	1.00
32	688331	荣昌生物	69,774	3,889,900.50	1.00
33	688599	天合光能	89,022	3,793,227.42	0.97
34	688343	云天励飞	4,742	240,277.14	0.06
35	688582	芯动联科	4,192	193,803.80	0.05
36	301486	致尚科技	2,585	149,051.10	0.04
37	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.04
38	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
39	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
40	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
41	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.02
42	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
43	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
44	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
45	688249	晶合集成	1,790	32,327.40	0.01
46	688472	阿特斯	1,600	27,264.00	0.01
47	301301	川宁生物	2,770	24,819.20	0.01
48	301293	三博脑科	316	22,568.72	0.01
49	688361	中科飞测	319	20,629.73	0.01
50	301325	曼恩斯特	182	19,646.90	0.01
51	301310	鑫宏业	294	19,236.42	0.00

52	688469	中芯集成	3,229	17,468.89	0.00
53	301358	湖南裕能	371	15,912.19	0.00
54	688478	晶升股份	354	14,998.98	0.00
55	688531	日联科技	110	14,956.70	0.00
56	301291	明阳电气	476	14,770.28	0.00
57	688562	航天软件	653	14,568.43	0.00
58	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
59	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
60	301260	格力博	591	13,965.33	0.00
61	688543	国科军工	260	13,793.00	0.00
62	301399	英特科技	261	13,459.77	0.00
63	301307	美利信	422	13,444.92	0.00
64	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
65	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
66	301408	华人健康	752	12,746.40	0.00
67	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
68	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
69	301262	海看股份	485	12,367.50	0.00
70	301382	蜂助手	376	12,347.84	0.00
71	301303	真兰仪表	550	12,276.00	0.00
72	301210	金杨股份	248	12,194.16	0.00
73	688146	中船特气	315	12,010.95	0.00
74	688334	西高院	730	11,833.30	0.00
75	301387	光大同创	258	11,702.88	0.00
76	301246	宏源药业	379	11,639.09	0.00
77	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
78	688458	美芯晟	127	11,526.52	0.00
79	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
80	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
81	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
82	688552	航天南湖	471	11,068.50	0.00
83	688352	颀中科技	902	10,887.14	0.00
84	688484	南芯科技	293	10,756.03	0.00
85	688570	天玛智控	408	10,334.64	0.00
86	301397	溯联股份	253	10,170.60	0.00
87	688512	慧智微	505	9,675.80	0.00
88	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
89	301332	德尔玛	702	9,638.46	0.00
90	688623	双元科技	111	9,633.69	0.00
91	301305	朗坤环境	481	9,470.89	0.00
92	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00

93	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
94	688581	安杰思	78	9,206.34	0.00
95	001287	中电港	429	9,017.58	0.00
96	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
97	688631	莱斯信息	300	8,961.00	0.00
98	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.00
99	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
100	301357	北方长龙	181	8,758.59	0.00
101	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
102	301373	凌玮科技	273	8,695.05	0.00
103	301386	未来电器	354	8,421.66	0.00
104	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
105	688433	华曙高科	257	8,095.50	0.00
106	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
107	301322	绿通科技	149	7,932.76	0.00
108	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
109	601061	中信金属	1,005	7,617.90	0.00
110	301439	泓淋电力	443	7,486.70	0.00
111	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
112	301281	科源制药	290	7,279.00	0.00
113	301203	国泰环保	210	7,224.00	0.00
114	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
115	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
116	688479	友车科技	233	6,871.17	0.00
117	603135	中重科技	337	6,028.93	0.00
118	301345	涛涛车业	116	5,410.24	0.00
119	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
120	601065	江盐集团	345	4,084.80	0.00
121	601133	柏诚股份	310	3,800.60	0.00
122	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
123	001328	登康口腔	127	3,237.23	0.00
124	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
125	603125	常青科技	102	2,502.06	0.00
126	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
127	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
128	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
129	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	000858	五粮液	30,295,383.00	8.50
2	300896	爱美客	21,501,558.34	6.03
3	301267	华夏眼科	18,470,102.49	5.18
4	688331	荣昌生物	16,925,199.02	4.75
5	300633	开立医疗	16,340,815.60	4.58
6	603486	科沃斯	15,410,245.00	4.32
7	001322	箭牌家居	15,123,172.00	4.24
8	688169	石头科技	14,797,264.60	4.15
9	300413	芒果超媒	13,753,757.00	3.86
10	688085	三友医疗	12,861,675.10	3.61
11	603027	千禾味业	12,588,832.84	3.53
12	002422	科伦药业	12,044,864.00	3.38
13	002790	瑞尔特	11,975,050.00	3.36
14	603517	绝味食品	11,843,437.58	3.32
15	000333	美的集团	11,466,505.00	3.22
16	603345	安井食品	11,452,232.40	3.21
17	600436	片仔癀	10,390,870.00	2.91
18	688126	沪硅产业	9,792,298.33	2.75
19	002867	周大生	9,704,425.25	2.72
20	002555	三七互娱	9,423,699.00	2.64
21	688198	佰仁医疗	9,093,948.37	2.55
22	300662	科锐国际	8,705,272.00	2.44
23	300957	贝泰妮	8,221,548.00	2.31
24	688363	华熙生物	7,811,405.33	2.19
25	000651	格力电器	7,778,556.00	2.18
26	688617	惠泰医疗	7,647,591.29	2.14
27	301102	兆讯传媒	7,381,447.28	2.07

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	000858	五粮液	50,137,304.00	14.06
2	600519	贵州茅台	32,358,588.00	9.08
3	600763	通策医疗	21,177,481.00	5.94
4	601888	中国中免	19,507,313.00	5.47
5	603288	海天味业	18,758,885.85	5.26
6	300413	芒果超媒	17,914,817.00	5.02
7	000963	华东医药	16,948,005.00	4.75

8	603517	绝味食品	13,429,649.00	3.77
9	000568	泸州老窖	12,764,617.00	3.58
10	002003	伟星股份	12,716,544.65	3.57
11	688331	荣昌生物	12,432,672.72	3.49
12	300633	开立医疗	11,664,358.00	3.27
13	300957	贝泰妮	11,373,867.00	3.19
14	600436	片仔癀	10,519,855.00	2.95
15	300347	泰格医药	10,129,392.93	2.84
16	002867	周大生	9,986,782.00	2.80
17	002555	三七互娱	9,434,909.26	2.65
18	688271	联影医疗	9,145,623.52	2.56
19	688382	益方生物	8,843,401.38	2.48
20	002027	分众传媒	8,245,773.00	2.31
21	603345	安井食品	7,505,999.33	2.11
22	301269	华大九天	7,492,654.82	2.10
23	301102	兆讯传媒	7,392,479.58	2.07
24	300286	安科瑞	7,143,338.00	2.00

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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	496,348,536.80
卖出股票收入（成交）总额	455,613,471.33

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	123,071.18
2	应收清算款	26,721,487.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,063.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,906,622.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
25,508	5,505.33	54,829,179.18	39.04%	85,600,738.84	60.96%

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	733,450.61	0.5223%

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	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年09月15日）基金份额总额	3,309,251,362.03
本报告期期初基金份额总额	116,779,938.67
本报告期基金总申购份额	52,359,530.96
减：本报告期基金总赎回份额	28,709,551.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	140,429,918.02

§ 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	
财达证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	90,272,719.02	9.59%	65,114.32	7.63%	-
申万宏源 证券	1	128,084,758.82	13.61%	119,287.17	13.97%	-
英大证券	1	369,581,453.79	39.27%	340,497.22	39.88%	-

中泰证券	1	353,177,073.59	37.53%	328,915.73	38.52%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
 - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
 - (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
 - (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
 - (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	31,152,000.00	100.00%	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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个人电子银行基金申购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“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
3	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
4	诺安主题精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023年01月20日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行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》	2023年03月14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	诺安主题精选混合型证券投资基金 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增加安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》	2023年04月21日
10	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
11	诺安主题精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023年04月22日
12	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
13	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	20230411-20230630	-	33,709,771.47	1,851,547.18	31,858,224.29	22.69%
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主题精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安主题精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安主题精选混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安主题精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安主题精选混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2023 年 08 月 31 日