

诺安中小盘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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	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合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	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	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	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	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55

7.12	投资组合报告附注	55
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中小盘精选混合型证券投资基金
基金简称	诺安中小盘精选混合
基金主代码	320011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 04 月 28 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	276,559,503.87 份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为五部分：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略以及权证投资策略。</p> <p>1、资产配置策略 本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法，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，力图通过时机选择达到在承受一定风险的前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2、股票投资策略 本基金的股票投资策略分三步进行，首先是确定基本股票池，其次是进行个股基本面鉴别，最后是股票组合最终确认。</p> <p>3、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券投资策略 本基金的债券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(Interest rate anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield spread analysis)以及个券估值策略(Valuation analysis)等。</p> <p>5、权证投资策略 本基金的权证投资部分主要运用的投资策略包括：价值发现策略和价差策略。作为辅助性投资工具，本基金结合自身资产状况审慎投资于权证资产，力图获得最佳风险调整收益。</p>

业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	34,717,869.75
本期利润	66,817,381.48
加权平均基金份额本期利润	0.3814
本期加权平均净值利润率	12.82%
本期基金份额净值增长率	19.26%
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	537,718,797.72

期末可供分配基金份额利润	1.9443
期末基金资产净值	851,278,872.46
期末基金份额净值	3.078
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	386.12%

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	1.79%	0.90%	0.33%	0.76%	1.46%	0.14%
过去三个月	0.85%	0.91%	-3.47%	0.71%	4.32%	0.20%
过去六个月	19.26%	1.03%	3.22%	0.68%	16.04%	0.35%
过去一年	16.41%	0.93%	-5.72%	0.76%	22.13%	0.17%
过去三年	40.55%	1.12%	5.15%	0.97%	35.40%	0.15%
自基金合同生效起至今	386.12%	1.25%	43.09%	1.21%	343.03%	0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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		
韩冬燕	本基金基金经理	2016年09月 13日	-	19年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于华夏基金管理有限公司，先后从事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司，从事行业研究工作，现任公司总经理助理、权益投资事业部总经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理，2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理，2019年4月起任诺安恒鑫混合型证券投资基金基金

					经理，2023 年 2 月起任诺安低碳经济股票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本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

我们认为中国宏观经济走在长期高质量发展的路上，近几年阶段性的弱势是多重因素叠加导致的，特别是疫情和房地产压力的并行，给经济带来了比较大的下行压力；在中国疫情防控政策于 2022 年底全面放开后，在多地出台稳住房地产发展和促进经济增长的措施后，2023 年的宏观经济，已经挺过了艰难时期，逐步回到良性的发展；对证券市场而言，随着经济的向上修复和结构优化，今年是可以积极寻找生生不息的力量和结构性机会的一年。

从疫情重启效应向常态化的资产负债表修复再到资产负债表扩张要经历一个复杂过程，其中可能存在很多波动和反复，2023 上半年宏观经济总体呈现温和复苏，存在结构性特征。2023 年上半年的宏观经济和资本市场的阶段表现体现出，信心有所上升、但行动迟疑，预期改善、但不巩固，结构化特征明显、科技先行。

在基金操作策略上，本基金通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。2023 年上半年，在权衡长期和短期后，我们在科技、消费和新能源等代表未来的行业方向上进行了相关配置，在科技大方向中对通信运营商、产业数字化和智能物联等相关细分领域进行了重点配置，从微观的、长期的角度精选能符合我们长期收益率预期的优秀中小市值个股。

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 3.078 元，本报告期内基金份额净值增长率为 19.26%，同期业绩比较基准收益率为 3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于上半年经济复苏的结构性不同步和不够强势，我们不倾向于过度放大长期的担心，我们认为经济复苏态势、增长政策、改革方向、地缘政治演变、预期修正等多因素会互为因果、复杂演绎，长期震荡向上演绎。

市场估值总体处于历史偏低区域，较为充分甚至过度反应盈利预期的下行，而宏观政策逐渐加力、流动性较为宽松，中观角度，以科技、高端制造为代表的新产业趋势向好，中微观角度，能反映经济复苏和结构优化、中报盈利表现较好的细分方向和优秀公司将逐渐体现盈利驱动的机会。从中长期产业结构变迁趋势、产业发展空间和行业景气度等角度考量，消费制造、数字化时代中的科技运用和新能源等依然是中长期需要我们重点关注的方向。

投资的长期成功需要基金经理与时俱进、持续成长，看长看大、做时代同频共振者，向下扎根、做产业先锋同行者，深入其中，又出乎其外。我们努力做持续成长的基金经理，客观面对不足，持续优化投资体系，在短期变幻莫测的市场中，尽力排除短期扰动，善于改变、勇于坚持。

衷心感谢持有人把投资的任务托付给我们！

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该次可供分配利润的 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：诺安中小盘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	86,687,835.70	50,861,597.04
结算备付金		1,990,846.54	179,916.72
存出保证金		112,844.88	81,363.93
交易性金融资产	6.4.7.2	767,938,776.08	281,262,570.64
其中：股票投资		767,938,776.08	281,262,570.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		1,189,047.98	79,909.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		857,919,351.18	332,465,357.43
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		4,272,852.09	-
应付赎回款		510,905.26	145,671.41
应付管理人报酬		1,019,881.23	428,035.06
应付托管费		169,980.21	71,339.17
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	666,859.93	152,646.15
负债合计		6,640,478.72	797,691.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	276,559,503.87	128,518,743.78
未分配利润	6.4.7.8	574,719,368.59	203,148,921.86
净资产合计		851,278,872.46	331,667,665.64
负债和净资产总计		857,919,351.18	332,465,357.43

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.078 元，基金份额总额 276,559,503.87 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中小盘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		71,397,416.97	-76,502,076.39
1. 利息收入		137,870.15	98,319.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	137,870.15	98,319.33
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）		39,041,121.43	-36,169,999.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,987,533.28	-39,631,170.87
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	8,053,588.15	3,461,170.97
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	32,099,511.73	-40,439,466.10
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	118,913.66	9,070.28
减：二、营业总支出		4,580,035.49	3,387,334.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,847,790.22	2,825,447.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	641,298.41	470,907.96
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	90,946.86	90,978.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,817,381.48	-79,889,410.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,817,381.48	-79,889,410.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		66,817,381.48	-79,889,410.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安中小盘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）	128,518,743.78	-	203,148,921.86	331,667,665.64
二、本期期初净资产（基金净值）	128,518,743.78	-	203,148,921.86	331,667,665.64
三、本期增减变动额（减少以	148,040,760.09	-	371,570,446.73	519,611,206.82

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	66,817,381.48	66,817,381.48
(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)	148,040,760.09	-	304,753,065.25	452,793,825.34
其中: 1. 基金申购款	179,981,503.28	-	370,214,511.77	550,196,015.05
2. 基金赎回款	-31,940,743.19	-	-65,461,446.52	-97,402,189.71
(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)	276,559,503.87	-	574,719,368.59	851,278,872.46
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)	140,684,650.62	-	311,103,665.60	451,788,316.22
二、本期期初净资产(基金净值)	140,684,650.62	-	311,103,665.60	451,788,316.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	968,793.92	-	-78,210,903.02	-77,242,109.10
(一)、综合收益总额	-	-	-79,889,410.86	-79,889,410.86
(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)	968,793.92	-	1,678,507.84	2,647,301.76
其中: 1. 基金申购款	7,593,802.47	-	12,963,021.53	20,556,824.00
2. 基金赎回款	-6,625,008.55	-	-11,284,513.69	-17,909,522.24
(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)	141,653,444.54	-	232,892,762.58	374,546,207.12

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

诺安中小盘精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）原名为诺安中小盘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》（证监会令第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，诺安中小盘精选股票型证券投资基金名称变更为诺安中小盘精选混合型证券投资基金。原诺安中小盘精选股票型证券投资基金经中国证监会《关于核准诺安中小盘精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2010〕209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《诺安中小盘精选股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2010年4月28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1,428,556,041.60份基金份额，其中认购资金利息折合71,086.09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》及其配套规则、《诺安中小盘精选混合型证券投资基金合同》和《诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）、央行票据、资产支持证券、权证以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，股票、存托凭证等权益类金融工具投资比例占基金资产净值的60%-95%（其中权证投资比例不超过基金资产净值的3%）；债券等固定收益类金融工具投资比例占基金资产净值的5%-40%（其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款）；本基金将不低于80%的股票、存托凭证资产投资于国内股票市场上具有良好成长性和基本面的中小盘股票。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	86,687,835.70
等于：本金	86,679,710.08
加：应计利息	8,125.62
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	86,687,835.70

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	736,416,694.57	-	767,938,776.08	31,522,081.51
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	736,416,694.57	-	767,938,776.08	31,522,081.51

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	862.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	579,675.00
其中：交易所市场	579,675.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,322.86
合计	666,859.93

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	128,518,743.78	128,518,743.78
本期申购	179,981,503.28	179,981,503.28
本期赎回（以“-”号填列）	-31,940,743.19	-31,940,743.19
本期末	276,559,503.87	276,559,503.87

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	221,727,585.58	-18,578,663.72	203,148,921.86
本期利润	34,717,869.75	32,099,511.73	66,817,381.48
本期基金份额交易产生的变动数	281,273,342.39	23,479,722.86	304,753,065.25
其中：基金申购款	341,935,246.64	28,279,265.13	370,214,511.77
基金赎回款	-60,661,904.25	-4,799,542.27	-65,461,446.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	537,718,797.72	37,000,570.87	574,719,368.59

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	130,638.52
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	5,322.25
其他	1,909.38
合计	137,870.15

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	252,695,203.79
减：卖出股票成本总额	220,530,353.23
减：交易费用	1,177,317.28
买卖股票差价收入	30,987,533.28

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	8,053,588.15
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	8,053,588.15

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	32,099,511.73
— 股票投资	32,099,511.73
— 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	32,099,511.73

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	116,796.75
基金转换费收入	2,116.91
合计	118,913.66

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	124.00
账户维护费	9,000.00
合计	90,946.86

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	3,847,790.22	2,825,447.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,343,157.14	839,750.75

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	641,298.41	470,907.96
----------------	------------	------------

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自有资金投资本基金的情况

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

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
中国工商银行股份有限公司	86,687,835.70	130,638.52	84,092,086.83	94,448.12

司-活期存款				
--------	--	--	--	--

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	-
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	482	5,726.16	10,131.64	-
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	143	2,957.24	3,645.07	-
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	-

		日								
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	-
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	404	20,200.00	12,406.84	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	631	19,466.35	14,910.53	-

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	688	20,791.36	17,544.00	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.54	25.10	332	10,470.66	8,333.20	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	1,007	38,396.91	31,247.21	-
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	2,681	13,405.00	24,021.76	-
301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	561	15,034.80	12,521.52	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	677	17,094.25	13,330.13	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	472	15,264.48	15,037.92	-
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	-
301311	威士	2023年	6个月	新股锁	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

5	顿	06月13日		定							
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	87.41	53.24	156	13,635.44	8,305.44	-	
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	260	19,968.00	28,067.00	-	
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	989	14,647.09	13,578.97	-	
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	123	9,034.35	5,736.72	-	
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	-	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	378	8,985.06	16,212.42	-	
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	-	

		日								
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	291	16,971.12	13,199.76	-
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	771	12,521.04	13,068.45	-
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	465	9,295.35	7,858.50	-
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	1,129	7,428.82	8,557.82	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	388	4,019.68	4,593.92	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	348	4,057.68	4,266.48	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	114	2,961.72	2,796.42	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	379	6,746.20	6,780.31	-
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	354	12,797.10	13,498.02	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	2,518	50,007.48	45,475.08	-
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	1,012	12,245.20	12,214.84	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	449	10,596.40	29,036.83	-
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	289	7,704.74	9,103.50	-
68845	美芯	2023年	6个月	新股锁	75.00	90.76	178	13,350.00	16,155.28	-

8	晟	05月15日		定						
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	4,534	25,798.46	24,528.94	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	2,254	25,019.40	38,408.16	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	398	12,942.96	16,863.26	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	327	11,114.73	9,643.23	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	335	13,396.65	12,297.85	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	165.61	122.11	86	14,242.48	10,501.46	-
688512	慧智微	2023年05月08日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	707	14,790.44	13,546.12	-
688522	纳睿雷达	2023年02月22日	6个月	新股锁定	46.68	51.50	2,348	109,604.64	120,922.00	-
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	122	18,590.36	16,588.34	-
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	663	14,035.71	15,580.50	-
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	-

		日								
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	542	16,400.92	13,728.86	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	107	13,460.60	12,629.21	-
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	154	19,385.52	13,365.66	-
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	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工商银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易

对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无债券投资（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公司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、存出保证金和应收申购款等。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日						
资产						
银行存款	86,687,835.70	-	-	-	-	86,687,835.70
结算备付金	1,990,846.54	-	-	-	-	1,990,846.54
存出保证金	112,844.88	-	-	-	-	112,844.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-767,938,776.08	767,938,776.08
应收申购款	-	-	-	-	1,189,047.98	1,189,047.98
资产总计	88,791,527.12	-	-	-	-769,127,824.06	857,919,351.18
负债						
应付清算款	-	-	-	-	4,272,852.09	4,272,852.09
应付赎回款	-	-	-	-	510,905.26	510,905.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,019,881.23	1,019,881.23
应付托管费	-	-	-	-	169,980.21	169,980.21
其他负债	-	-	-	-	666,859.93	666,859.93
负债总计	-	-	-	-	6,640,478.72	6,640,478.72
利率敏感度缺口	88,791,527.12	-	-	-	-762,487,345.34	851,278,872.46
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	50,861,597.04	-	-	-	-	50,861,597.04
结算备付金	179,916.72	-	-	-	-	179,916.72
存出保证金	81,363.93	-	-	-	-	81,363.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-281,262,570.64	281,262,570.64
应收申购款	4,429.00	-	-	-	75,480.10	79,909.10
资产总计	51,127,306.69	-	-	-	-281,338,050.74	332,465,357.43
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	145,671.41	145,671.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	428,035.06	428,035.06
应付托管费	-	-	-	-	71,339.17	71,339.17
其他负债	-	-	-	-	152,646.15	152,646.15
负债总计	-	-	-	-	797,691.79	797,691.79
利率敏感度缺口	51,127,306.69	-	-	-	-280,540,358.95	331,667,665.64

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，本基金无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	767,938,776.08	90.21	281,262,570.64	84.80
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	767,938,776.08	90.21	281,262,570.64	84.80

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%	40,133,507.12	10,849,426.67
业绩比较基准下降 5%	-40,133,507.12	-10,849,426.67	

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	765,821,274.21	279,830,532.24
第二层次	865,434.18	-
第三层次	1,252,067.69	1,432,038.40
合计	767,938,776.08	281,262,570.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	767,938,776.08	89.51
	其中：股票	767,938,776.08	89.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	88,678,682.24	10.34
8	其他各项资产	1,301,892.86	0.15
9	合计	857,919,351.18	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	19,066.20	0.00
B	采矿业	24,774,609.05	2.91
C	制造业	495,751,115.71	58.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,207,827.66	1.32
E	建筑业	120,384.25	0.01
F	批发和零售业	81,487,531.02	9.57
G	交通运输、仓储和邮政业	11,065,707.70	1.30
H	住宿和餐饮业	11,777.40	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,977,855.88	12.45
J	金融业	11,014,328.12	1.29
K	房地产业	11,670.75	0.00
L	租赁和商务服务业	24,081,070.88	2.83
M	科学研究和技术服务业	969,109.72	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	800,143.11	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	472,845.99	0.06

R	文化、体育和娱乐业	173,732.64	0.02
S	综合	-	-
	合计	767,938,776.08	90.21

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	601607	上海医药	3,606,031	80,811,154.71	9.49
2	600166	福田汽车	15,800,000	53,720,000.00	6.31
3	601728	中国电信	9,265,590	52,165,271.70	6.13
4	000333	美的集团	660,015	38,888,083.80	4.57
5	600050	中国联通	7,700,047	36,960,225.60	4.34
6	601138	工业富联	1,330,000	33,516,000.00	3.94
7	002236	大华股份	1,580,089	31,206,757.75	3.67
8	600750	江中药业	1,390,075	30,484,344.75	3.58
9	002867	周大生	1,580,000	28,092,400.00	3.30
10	603501	韦尔股份	269,975	26,468,349.00	3.11
11	600612	老凤祥	369,943	25,851,616.84	3.04
12	601857	中国石油	3,300,000	24,651,000.00	2.90
13	300662	科锐国际	680,038	24,052,944.06	2.83
14	603986	兆易创新	206,000	21,887,500.00	2.57
15	688599	天合光能	508,000	21,645,880.00	2.54
16	601615	明阳智能	1,260,062	21,269,846.56	2.50
17	000887	中鼎股份	1,580,000	20,682,200.00	2.43
18	600398	海澜之家	2,600,000	17,888,000.00	2.10
19	603345	安井食品	120,000	17,616,000.00	2.07
20	300037	新宙邦	330,000	17,123,700.00	2.01
21	603019	中科曙光	330,000	16,797,000.00	1.97
22	688166	博瑞医药	524,287	11,529,071.13	1.35
23	600905	三峡能源	2,060,000	11,062,200.00	1.30
24	000089	深圳机场	1,580,000	10,981,000.00	1.29
25	002966	苏州银行	1,660,000	10,873,000.00	1.28
26	000869	张裕A	330,000	10,117,800.00	1.19
27	000550	江铃汽车	644,100	8,914,344.00	1.05
28	603596	伯特利	108,400	8,591,784.00	1.01
29	301208	中亦科技	120,000	6,639,600.00	0.78
30	600941	中国移动	60,000	5,598,000.00	0.66
31	603899	晨光股份	120,015	5,357,469.60	0.63
32	600089	特变电工	160,000	3,566,400.00	0.42

33	688249	晶合集成	25,174	472,993.80	0.06
34	688472	阿特斯	22,537	410,804.04	0.05
35	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.04
36	688343	云天励飞	5,325	338,723.25	0.04
37	301291	明阳电气	10,064	326,505.41	0.04
38	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
39	301325	曼恩斯特	2,591	294,966.50	0.03
40	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.03
41	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.03
42	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
43	688392	骄成超声	2,498	277,253.02	0.03
44	688387	信科移动	31,360	261,856.00	0.03
45	688469	中芯集成	45,331	255,847.93	0.03
46	688205	德科立	3,389	247,803.68	0.03
47	301311	昆船智能	8,320	245,273.60	0.03
48	301301	川宁生物	26,805	240,172.80	0.03
49	688172	燕东微	9,964	236,943.92	0.03
50	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.03
51	301286	侨源股份	7,839	231,250.50	0.03
52	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.03
53	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.03
54	688382	益方生物	16,677	228,308.13	0.03
55	688262	国芯科技	5,282	214,924.58	0.03
56	688110	东芯股份	5,759	207,899.90	0.02
57	688435	英方软件	2,728	207,437.12	0.02
58	688362	甬矽电子	6,068	202,003.72	0.02
59	688400	凌云光	6,465	197,053.20	0.02
60	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.02
61	688486	龙迅股份	1,739	191,376.95	0.02
62	301262	海看股份	6,871	189,122.25	0.02
63	688373	盟科药业	22,055	188,570.25	0.02
64	301330	熵基科技	5,247	187,737.66	0.02
65	688478	晶升股份	3,972	186,664.00	0.02
66	301302	华如科技	4,993	183,742.40	0.02
67	688035	德邦科技	3,088	183,674.24	0.02
68	688531	日联科技	1,211	178,315.73	0.02
69	688428	诺诚健华	15,271	176,380.05	0.02
70	688409	富创精密	1,604	174,836.00	0.02
71	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.02
72	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.02
73	688458	美芯晟	1,771	169,354.09	0.02

74	301230	泓博医药	3,762	168,913.80	0.02
75	688552	航天南湖	6,621	166,258.32	0.02
76	301358	湖南裕能	3,778	165,846.42	0.02
77	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.02
78	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
79	301308	江波龙	1,573	160,068.48	0.02
80	301339	通行宝	6,365	159,952.45	0.02
81	301307	美利信	4,714	158,459.94	0.02
82	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.02
83	688380	中微半导	5,301	157,386.69	0.02
84	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.02
85	301248	杰创智能	6,985	155,555.95	0.02
86	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.02
87	688403	汇成股份	12,699	155,181.78	0.02
88	301260	格力博	6,306	154,345.28	0.02
89	688432	有研硅	9,741	152,836.29	0.02
90	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.02
91	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.02
92	688146	中船特气	3,539	147,905.02	0.02
93	301127	天源环保	14,918	146,345.58	0.02
94	301112	信邦智能	3,984	145,854.24	0.02
95	688512	慧智微	7,064	145,008.88	0.02
96	301391	卡莱特	1,235	144,704.95	0.02
97	688206	概伦电子	5,160	144,686.40	0.02
98	301109	军信股份	8,729	144,115.79	0.02
99	688195	腾景科技	2,693	143,886.99	0.02
100	688570	天玛智控	5,417	143,598.86	0.02
101	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
102	301387	光大同创	2,906	142,197.71	0.02
103	688503	聚和材料	1,455	141,862.50	0.02
104	301332	德尔玛	9,886	140,717.10	0.02
105	688623	双元科技	1,540	140,697.48	0.02
106	301305	朗坤环境	6,770	140,125.46	0.02
107	301338	凯格精机	3,595	139,845.50	0.02
108	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.02
109	301363	美好医疗	3,153	138,700.47	0.02
110	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
111	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.02
112	301160	翔楼新材	3,918	137,717.70	0.02
113	688192	迪哲医药	3,960	137,412.00	0.02
114	688484	南芯科技	3,342	136,186.25	0.02

115	301212	联盛化学	4,158	136,132.92	0.02
116	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.02
117	688352	颀中科技	10,112	134,518.84	0.02
118	301408	华人健康	7,705	133,442.69	0.02
119	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.02
120	001287	中电港	4,819	130,613.50	0.02
121	688273	麦澜德	3,517	130,164.17	0.02
122	688581	安杰思	1,062	129,607.16	0.02
123	688292	浩瀚深度	4,503	129,236.10	0.02
124	301221	光庭信息	2,312	129,078.96	0.02
125	688351	微电生理	6,613	128,755.11	0.02
126	301303	真兰仪表	5,604	127,804.50	0.02
127	688119	中钢洛耐	22,877	127,653.66	0.01
128	688376	美埃科技	3,206	126,604.94	0.01
129	301267	华夏眼科	2,072	126,288.40	0.01
130	688130	晶华微	2,863	126,258.30	0.01
131	301246	宏源药业	4,031	126,077.02	0.01
132	301132	满坤科技	4,282	125,847.98	0.01
133	688291	金橙子	3,961	125,405.26	0.01
134	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
135	301121	紫建电子	2,461	124,625.04	0.01
136	688152	麒麟信安	1,329	122,640.12	0.01
137	688259	创耀科技	1,542	122,049.30	0.01
138	688522	纳睿雷达	2,348	120,922.00	0.01
139	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.01
140	301377	鼎泰高科	5,194	119,462.00	0.01
141	301280	珠城科技	3,339	119,402.64	0.01
142	688416	恒烁股份	1,519	119,241.50	0.01
143	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
144	688419	耐科装备	2,735	116,456.30	0.01
145	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
146	301270	汉仪股份	2,095	114,407.95	0.01
147	688084	晶品特装	1,312	113,973.44	0.01
148	301328	维峰电子	1,979	112,684.26	0.01
149	301152	天力锂能	2,499	111,605.34	0.01
150	688489	三未信安	1,761	111,383.25	0.01
151	301296	新巨丰	6,593	111,289.84	0.01
152	688507	索辰科技	857	111,217.19	0.01
153	688114	华大智造	1,272	110,104.32	0.01
154	301277	新天地	5,560	108,475.60	0.01
155	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01

156	688253	英诺特	4,364	106,045.20	0.01
157	688132	邦彦技术	3,875	105,322.50	0.01
158	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.01
159	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
160	688251	井松智能	3,392	103,456.00	0.01
161	688227	品高股份	4,164	103,392.12	0.01
162	688231	隆达股份	3,613	103,078.89	0.01
163	688479	友车科技	3,263	102,039.15	0.01
164	301171	易点天下	4,561	100,798.10	0.01
165	301125	腾亚精工	3,270	99,931.20	0.01
166	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.01
167	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.01
168	688236	春立医疗	4,052	99,274.00	0.01
169	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01
170	301306	西测测试	2,543	98,795.55	0.01
171	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
172	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.01
173	601061	中信金属	11,289	97,762.62	0.01
174	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.01
175	688433	华曙高科	2,890	97,537.50	0.01
176	301220	亚香股份	2,849	97,179.39	0.01
177	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.01
178	688209	英集芯	5,867	95,749.44	0.01
179	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.01
180	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.01
181	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.01
182	688252	天德钰	4,606	93,455.74	0.01
183	301135	瑞德智能	3,376	92,569.92	0.01
184	301223	中荣股份	4,939	92,458.08	0.01
185	301231	荣信文化	2,744	92,308.16	0.01
186	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
187	301282	金禄电子	3,066	92,163.96	0.01
188	301335	天元宠物	3,835	91,426.40	0.01
189	301197	工大科雅	3,791	91,363.10	0.01
190	688247	宣泰医药	7,155	91,226.25	0.01
191	301151	冠龙节能	5,151	91,018.17	0.01
192	688353	华盛锂电	2,448	90,527.04	0.01
193	301290	东星医疗	2,808	89,996.40	0.01
194	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.01
195	301163	宏德股份	2,764	87,204.20	0.01
196	301281	科源制药	3,314	86,998.36	0.01

197	301322	绿通科技	1,548	86,466.24	0.01
198	301326	捷邦科技	2,264	86,099.92	0.01
199	688210	统联精密	4,347	84,853.44	0.01
200	688689	银河微电	3,258	84,056.40	0.01
201	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.01
202	301359	东南电子	3,271	83,345.08	0.01
203	301439	泓淋电力	4,648	82,483.22	0.01
204	301316	慧博云通	3,584	81,894.40	0.01
205	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
206	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.01
207	688184	帕瓦股份	2,615	81,744.90	0.01
208	300834	星辉环材	3,301	80,544.40	0.01
209	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
210	688105	诺唯赞	2,635	80,341.15	0.01
211	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.01
212	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.01
213	301161	唯万密封	3,460	79,960.60	0.01
214	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
215	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
216	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.01
217	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.01
218	688115	思林杰	2,024	78,187.12	0.01
219	688255	凯尔达	2,309	78,182.74	0.01
220	688173	希荻微	3,409	77,997.92	0.01
221	301288	清研环境	4,516	77,946.16	0.01
222	688799	华纳药厂	1,917	77,868.54	0.01
223	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
224	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
225	688381	帝奥微	2,363	76,277.64	0.01
226	603135	中重科技	3,785	76,262.71	0.01
227	301318	维海德	2,268	76,091.40	0.01
228	301265	华新环保	6,545	76,052.90	0.01
229	688420	美腾科技	1,960	75,910.80	0.01
230	688737	中自科技	1,943	75,757.57	0.01
231	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
232	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.01
233	688203	海正生材	5,109	70,402.02	0.01
234	688455	科捷智能	4,749	69,477.87	0.01
235	688171	纬德信息	2,821	68,945.24	0.01
236	301319	唯特偶	1,149	68,767.65	0.01
237	301283	聚胶股份	1,924	68,263.52	0.01

238	301233	盛帮股份	1,576	68,193.52	0.01
239	688265	南模生物	1,820	68,104.40	0.01
240	688448	磁谷科技	1,985	67,946.55	0.01
241	301182	凯旺科技	2,932	67,348.04	0.01
242	601136	首创证券	4,739	67,151.63	0.01
243	301166	优宁维	1,558	66,900.52	0.01
244	301300	远翔新材	2,107	66,581.20	0.01
245	301158	德石股份	3,783	65,483.73	0.01
246	688391	钜泉科技	945	64,883.70	0.01
247	301276	嘉曼服饰	2,534	64,617.00	0.01
248	688370	丛麟科技	1,667	63,312.66	0.01
249	301345	涛涛车业	1,226	58,360.85	0.01
250	301228	实朴检测	3,721	57,973.18	0.01
251	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.01
252	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.01
253	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.01
254	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.01
255	301153	中科江南	689	51,647.44	0.01
256	601065	江盐集团	3,878	51,464.62	0.01
257	601133	柏诚股份	3,478	50,934.78	0.01
258	688511	天微电子	1,490	50,809.00	0.01
259	301309	万得凯	1,834	50,508.36	0.01
260	301327	华宝新能	628	49,681.08	0.01
261	301196	唯科科技	1,460	49,567.00	0.01
262	301035	润丰股份	600	47,142.00	0.01
263	301349	信德新材	932	46,730.48	0.01
264	688509	正元地信	9,362	46,529.14	0.01
265	001328	登康口腔	1,423	45,616.27	0.01
266	301239	普瑞眼科	431	42,272.48	0.00
267	301269	华大九天	330	40,537.20	0.00
268	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.00
269	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
270	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
271	688275	万润新能	401	36,222.33	0.00
272	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
273	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.00
274	300919	中伟股份	530	31,932.50	0.00
275	603125	常青科技	1,138	31,929.22	0.00
276	688038	中科通达	2,132	31,894.72	0.00
277	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.00
278	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.00

279	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.00
280	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
281	300979	华利集团	615	29,975.10	0.00
282	301215	中汽股份	4,743	29,738.61	0.00
283	301029	怡合达	665	29,712.20	0.00
284	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.00
285	688361	中科飞测	449	29,036.83	0.00
286	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.00
287	301018	申菱环境	782	28,144.18	0.00
288	301175	中科环保	4,422	27,549.06	0.00
289	301039	中集车辆	2,064	27,306.72	0.00
290	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.00
291	301155	海力风电	346	26,669.68	0.00
292	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
293	301050	雷电微力	401	26,036.93	0.00
294	603255	鼎际得	489	24,821.64	0.00
295	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
296	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
297	301095	广立微	296	24,464.40	0.00
298	001339	智微智能	812	24,092.04	0.00
299	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.00
300	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
301	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.00
302	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.00
303	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.00
304	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.00
305	300860	锋尚文化	397	22,009.68	0.00
306	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
307	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.00
308	301263	泰恩康	1,017	21,234.96	0.00
309	301238	瑞泰新材	1,043	21,214.62	0.00
310	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
311	001322	箭牌家居	1,260	21,092.40	0.00
312	688701	卓锦股份	2,340	20,989.80	0.00
313	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.00
314	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.00
315	301168	通灵股份	329	20,496.70	0.00
316	301090	华润材料	1,560	19,687.20	0.00
317	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
318	301268	铭利达	458	19,176.46	0.00
319	301185	鸥玛软件	578	19,085.56	0.00

320	300972	万辰生物	430	19,066.20	0.00
321	605011	杭州热电	525	18,574.50	0.00
322	301099	雅创电子	351	18,273.06	0.00
323	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
324	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.00
325	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
326	605339	南侨食品	864	17,202.24	0.00
327	301030	仕净科技	242	16,722.20	0.00
328	300878	维康药业	722	16,389.40	0.00
329	301103	何氏眼科	377	15,818.92	0.00
330	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.00
331	301236	软通动力	576	15,672.96	0.00
332	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.00
333	300873	海晨股份	774	15,394.86	0.00
334	603132	金徽股份	1,342	15,218.28	0.00
335	300926	博俊科技	646	14,754.64	0.00
336	603230	内蒙新华	1,141	14,718.90	0.00
337	001228	永泰运	383	14,718.69	0.00
338	300918	南山智尚	1,063	14,594.99	0.00
339	603070	万控智造	775	14,484.75	0.00
340	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
341	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
342	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.00
343	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.00
344	301256	华融化学	1,555	13,777.30	0.00
345	301179	泽宇智能	407	13,715.90	0.00
346	301069	凯盛新材	539	13,712.16	0.00
347	301089	拓新药业	220	13,626.80	0.00
348	301102	兆讯传媒	499	13,408.13	0.00
349	605028	世茂能源	615	13,222.50	0.00
350	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
351	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
352	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
353	300908	仲景食品	285	12,924.75	0.00
354	301015	百洋医药	462	12,825.12	0.00
355	301199	迈赫股份	402	12,799.68	0.00
356	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.00
357	301149	隆华新材	1,214	12,674.16	0.00
358	605300	佳禾食品	576	12,522.24	0.00
359	605580	恒盛能源	916	12,356.84	0.00
360	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00

361	300864	南大环境	537	11,803.26	0.00
362	301073	君亭酒店	324	11,777.40	0.00
363	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.00
364	300917	特发服务	475	11,670.75	0.00
365	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
366	603170	宝立食品	542	11,522.92	0.00
367	301137	哈焊华通	644	11,508.28	0.00
368	301207	华兰疫苗	345	11,474.70	0.00
369	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
370	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.00
371	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
372	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
373	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
374	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
375	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
376	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
377	300868	杰美特	588	10,701.60	0.00
378	301017	漱玉平民	555	10,567.20	0.00
379	300881	盛德鑫泰	320	10,544.00	0.00
380	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
381	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
382	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00
383	300968	格林精密	1,162	10,330.18	0.00
384	603215	比依股份	575	10,315.50	0.00
385	001288	运机集团	537	10,149.30	0.00
386	301060	兰卫医学	587	10,149.23	0.00
387	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
388	301181	标榜股份	334	10,050.06	0.00
389	300877	金春股份	569	10,037.16	0.00
390	301100	风光股份	483	9,978.78	0.00
391	001366	播恩集团	646	9,961.32	0.00
392	001212	中旗新材	400	9,876.00	0.00
393	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
394	301200	大族数控	246	9,810.48	0.00
395	301110	青木股份	194	9,783.42	0.00
396	301222	浙江恒威	332	9,777.40	0.00
397	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
398	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
399	301020	密封科技	421	9,518.81	0.00
400	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
401	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.00

402	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.00
403	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
404	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.00
405	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
406	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
407	300876	蒙泰高新	350	9,117.50	0.00
408	301216	万凯新材	546	9,079.98	0.00
409	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
410	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
411	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
412	301045	天禄科技	335	8,870.80	0.00
412	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
414	300879	大叶股份	466	8,867.98	0.00
415	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
416	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00
417	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
418	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
419	301078	孩子王	756	8,641.08	0.00
420	301258	富士莱	217	8,532.44	0.00
421	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
422	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
423	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
424	301118	恒光股份	315	8,419.95	0.00
425	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
426	001210	金房能源	373	8,377.58	0.00
427	605189	富春染织	508	8,336.28	0.00
428	301193	家联科技	475	8,326.75	0.00
429	301066	万事利	482	8,309.68	0.00
430	605287	德才股份	349	8,271.30	0.00
431	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
432	300945	曼卡龙	531	8,241.12	0.00
433	301028	东亚机械	733	8,172.95	0.00
434	300985	致远新能	295	8,171.50	0.00
435	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
436	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
437	300930	屹通新材	322	8,033.90	0.00
438	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
439	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.00
440	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
441	300814	中富电路	328	7,901.52	0.00
442	300963	中洲特材	552	7,832.88	0.00

443	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
444	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
445	301133	金钟股份	286	7,596.16	0.00
446	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
447	301021	英诺激光	290	7,580.60	0.00
448	301108	洁雅股份	208	7,529.60	0.00
449	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
450	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
451	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
452	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
453	301088	戎美股份	403	7,201.61	0.00
454	300889	爱克股份	479	7,170.63	0.00
455	301041	金百泽	215	7,120.80	0.00
456	301011	华立科技	296	6,935.28	0.00
457	301059	金三江	492	6,888.00	0.00
458	300991	创益通	407	6,841.67	0.00
459	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
460	301198	喜悦智行	443	6,724.74	0.00
461	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
462	603150	万朗磁塑	251	6,616.36	0.00
463	301130	西点药业	237	6,512.76	0.00
464	300943	春晖智控	383	6,495.68	0.00
465	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
466	301237	和顺科技	214	6,353.66	0.00
467	301092	争光股份	241	6,309.38	0.00
468	301038	深水规院	346	6,259.14	0.00
469	300892	品渥食品	272	6,228.80	0.00
470	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
471	300998	宁波方正	201	6,027.99	0.00
472	300956	英力股份	371	5,835.83	0.00
473	301098	金埔园林	461	5,555.05	0.00
474	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
475	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
476	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
477	300975	商络电子	738	5,276.70	0.00
478	300931	通用电梯	672	5,275.20	0.00
479	301219	腾远钴业	140	5,230.40	0.00
480	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
481	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.00
482	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
483	300948	冠中生态	324	4,895.64	0.00

484	300960	通业科技	234	4,874.22	0.00
485	301068	大地海洋	144	4,839.84	0.00
486	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
487	301007	德迈仕	303	4,675.29	0.00
488	301032	新柴股份	513	4,591.35	0.00
489	301072	中捷精工	181	4,534.05	0.00
490	300886	华业香料	191	4,436.93	0.00
491	301010	晶雪节能	218	4,423.22	0.00
492	301049	超越科技	196	4,331.60	0.00
493	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
494	300961	深水海纳	394	4,243.38	0.00
495	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
496	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
497	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00
498	301079	邵阳液压	182	3,880.24	0.00
499	301036	双乐股份	205	3,839.65	0.00
500	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
501	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
502	300929	华骐环保	293	3,319.69	0.00
503	000988	华工科技	32	1,216.32	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	601607	上海医药	78,925,962.17	23.80
2	600166	福田汽车	53,354,456.00	16.09
3	000333	美的集团	48,030,923.25	14.48
4	601728	中国电信	37,749,523.88	11.38
5	601857	中国石油	36,129,382.00	10.89
6	688599	天合光能	28,710,358.81	8.66
7	002867	周大生	26,057,837.90	7.86
8	603501	韦尔股份	25,587,736.05	7.71
9	600050	中国联通	24,982,375.00	7.53
10	002236	大华股份	22,893,552.00	6.90
11	600612	老凤祥	22,272,406.91	6.72
12	000887	中鼎股份	20,242,466.00	6.10
13	601615	明阳智能	19,121,350.00	5.77
14	603345	安井食品	19,068,810.00	5.75
15	600398	海澜之家	18,089,046.00	5.45

16	603019	中科曙光	16,342,294.89	4.93
17	300662	科锐国际	16,196,788.00	4.88
18	600750	江中药业	13,888,976.50	4.19
19	601138	工业富联	13,728,974.00	4.14
20	603986	兆易创新	12,883,541.00	3.88
21	688166	博瑞医药	12,178,526.60	3.67
22	600018	上港集团	11,472,128.43	3.46
23	600332	白云山	10,154,160.63	3.06
24	000550	江铃汽车	9,810,269.00	2.96
25	603596	伯特利	8,382,709.62	2.53
26	600104	上汽集团	8,206,567.12	2.47
27	001323	慕思股份	7,559,065.00	2.28
28	301208	中亦科技	7,349,500.00	2.22

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	601138	工业富联	27,439,204.00	8.27
2	601728	中国电信	18,296,087.00	5.52
3	002236	大华股份	17,965,357.40	5.42
4	601857	中国石油	15,456,082.00	4.66
5	600050	中国联通	13,891,165.00	4.19
6	002439	启明星辰	12,232,316.50	3.69
7	600018	上港集团	11,292,119.00	3.40
8	000333	美的集团	10,943,346.00	3.30
9	600332	白云山	10,001,702.00	3.02
10	601169	北京银行	8,782,669.54	2.65
11	601186	中国铁建	8,534,116.00	2.57
12	600887	伊利股份	8,441,155.48	2.55
13	000988	华工科技	8,212,409.12	2.48
14	600941	中国移动	8,157,074.28	2.46
15	600104	上汽集团	7,820,226.80	2.36
16	000858	五粮液	7,454,745.00	2.25
17	688599	天合光能	7,422,341.86	2.24
18	601390	中国中铁	7,387,219.20	2.23
19	001323	慕思股份	5,673,564.58	1.71
20	002966	苏州银行	4,582,458.00	1.38

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	675,107,046.94
卖出股票收入（成交）总额	252,695,203.79

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	112,844.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,189,047.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,301,892.86

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
15,773	17,533.73	83,351,763.01	30.14%	193,207,740.86	69.86%

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	47,603.08	0.0172%

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（2010年04月28日）基金份额总 额	1,428,556,041.60
本报告期期初基金份额总额	128,518,743.78
本报告期基金总申购份额	179,981,503.28
减：本报告期基金总赎回份额	31,940,743.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	276,559,503.87

§ 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	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	674,047,421.51	73.66%	627,745.00	73.86%	-
国海证券	1	241,092,479.88	26.34%	222,118.08	26.14%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

本基金租用的证券公司交易单元本报告期末未进行其他证券投资交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于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	诺安中小盘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
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	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年03月10日
6	诺安中小盘精选混合型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03月10日
7	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《上海证券报》	2023年03月10日
8	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
9	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
10	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
11	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
12	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 202	基金管理人网站	2023年03月31日

	2 年年度报告		
13	诺安中小盘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
14	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
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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 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中小盘精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中小盘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中小盘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报告期内诺安中小盘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