

诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 09 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 诺安积极回报混合 |
| 基金主代码 | 001706 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 09 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 77,085,294.62 份 |
| 投资目标 | 本基金通过灵活的大类资产配置和个股精选，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金通过灵活配置大类资产，动态控制组合风险，并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>比例，并随着各类金融风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资分析</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%</p> |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 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。 | |
| 基金管理人 | 诺安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 江苏银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 诺安积极回报混合 A | 诺安积极回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001706 | 012847 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 53,914,913.20 份 | 23,170,381.42 份 |

注：自 2021 年 7 月 6 日起，本基金增加基金份额类别，分设 A 类基金份额和 C 类基金份额。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 07 月 01 日-2022 年 09 月 30 日） | |
|-----------------|--|---------------|
| | 诺安积极回报混合 A | 诺安积极回报混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -223,139.86 | -95,389.44 |
| 2. 本期利润 | -9,203,928.02 | -4,301,042.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.4669 | -0.2410 |
| 4. 期末基金资产净值 | 87,760,876.65 | 40,177,629.51 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.628 | 1.734 |

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、自 2021 年 07 月 06 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额，详情请参阅相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

诺安积极回报混合 A

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -9.51% | 1.13% | -8.72% | 0.53% | -0.79% | 0.60% |
| 过去六个月 | -11.76% | 1.17% | -4.80% | 0.71% | -6.96% | 0.46% |
| 过去一年 | -21.28% | 1.12% | -11.64% | 0.70% | -9.64% | 0.42% |
| 过去三年 | 23.99% | 1.17% | 6.86% | 0.75% | 17.13% | 0.42% |
| 过去五年 | 59.30% | 0.96% | 12.57% | 0.76% | 46.73% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 62.80% | 0.88% | 23.53% | 0.71% | 39.27% | 0.17% |

诺安积极回报混合 C

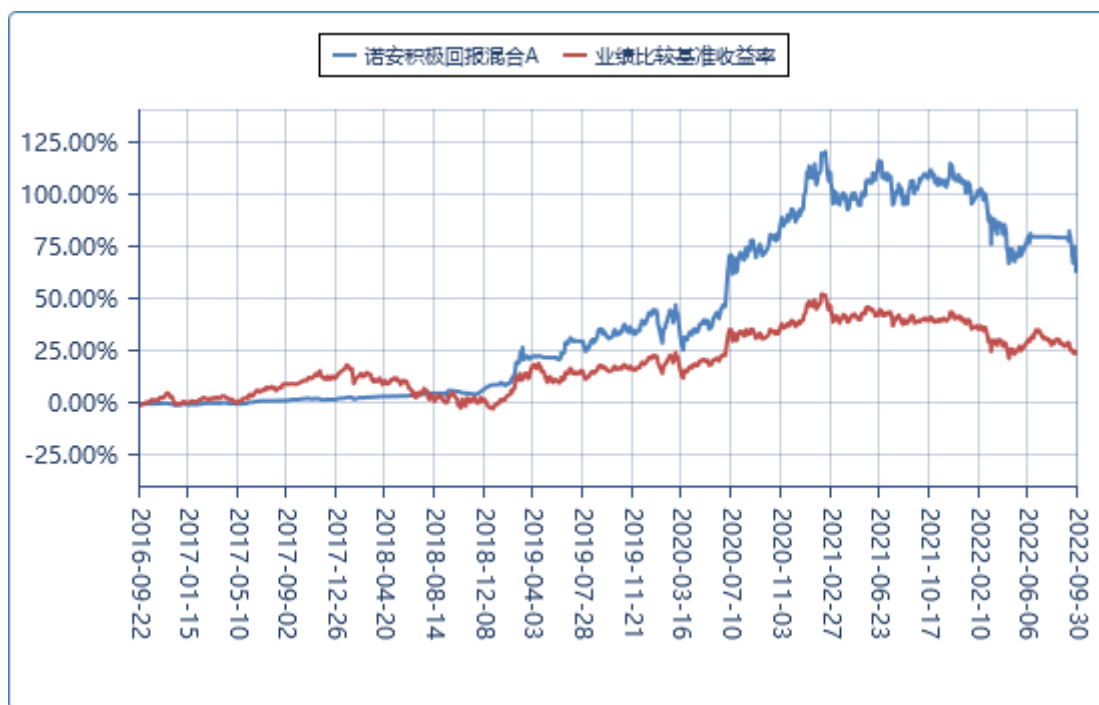
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -9.69% | 1.14% | -8.72% | 0.53% | -0.97% | 0.61% |
| 过去六个月 | -5.76% | 1.21% | -4.80% | 0.71% | -0.96% | 0.50% |
| 过去一年 | -16.07% | 1.14% | -11.64% | 0.70% | -4.43% | 0.44% |
| 自基金合同生效起至今 | -17.51% | 1.13% | -13.85% | 0.71% | -3.66% | 0.42% |

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

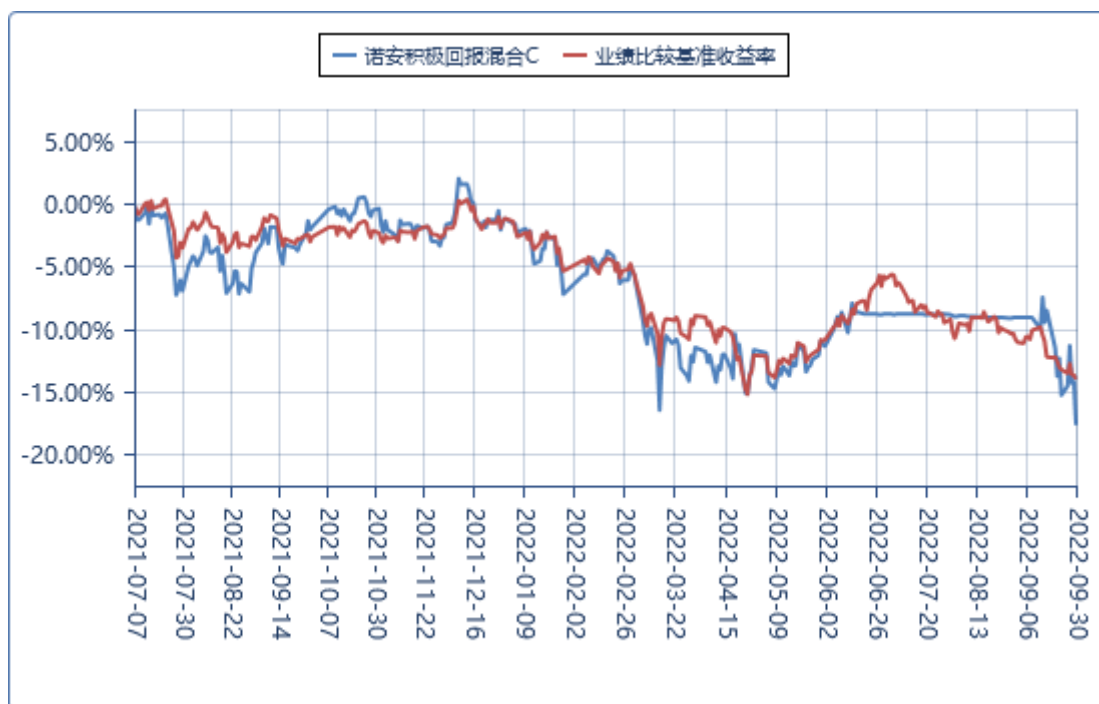
2、自 2021 年 07 月 06 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额；其中 C 类份额自 2021 年 07 月 07 日开始有申购数据，C 类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2021 年 07 月 08 日）算起。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

诺安积极回报混合 A



诺安积极回报混合 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|---------|------------------|------------------|------|--|
| 蔡嵩松 | 本基金基金经理 | 2022 年 08 月 20 日 | - | 7 年 | <p>博士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、华泰证券股份有限公司，2017 年 11 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员，现任投资管理部副总经理。2019 年 2 月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 5 月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 7 月起任诺安优化配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 宋德舜 | 本基金基金经理 | 2019 年 08 月 27 日 | 2022 年 08 月 20 日 | 15 年 | <p>博士，具有基金从业资格。曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理，泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010 年 4 月加入诺安基金管理有限公司，历任投资经理。2012 年 12 月至 2015 年 3 月任诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2011 年 4 月至 2017 年 8 月任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理和诺</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012 年 12 月至 2017 年 8 月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 5 月至 2022 年 4 月任诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月至 2022 年 8 月任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 3 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：①此处基金经理的任职日期、离任日期均为公司作出决定并对外公告之日；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

芯片板块自 2021 年 7 月 30 日下跌至今，已经超过了一年的时间，无论是回撤空间维度还是下跌横盘时间维度都已经较大。8 月 1 日，在佩洛西窜访台湾的刺激下，叠加美国禁售 14nm 以上制程设备、美国科学芯片基金扶持本地产业、美国意图成立 CHIP4 联盟、美国计划禁运 EDA 工具等遏制中国芯片产业的政策，国人的民族自尊心被彻底激发，整个板块在 EDA 的带领下，出现了一波急涨反弹行情。

但是，今年行情演绎的关键词是景气度至上，短期景气度的权重在今年的行情里达到了极致，所以我们才看到了前有汽车，后有逆变器的大行情。而芯片行业的景气度在今年是所有行业里最差的，疫情影响需求，以消费电子需求大幅下滑和库存累计带来了景气度下行逐渐蔓延，蔓延到即使是设备板块整体的高增长，也被市场解读为短暂的，未来因为需求不行扩产紧缩，设备就会断崖。国产替代的逻辑完全被抛之

脑后，视而不见。

本轮芯片行情要想起来观察的最重要的变量是消费电子的销量数据同比转正。目前看来，离转正还有很长的路要走，但是已经看到曙光。三季度是消化库存的关键季度，市场需要观测三季报数据，看看重压之下毛利率会下滑到什么水平，看看毛利大幅下滑之后，股价会有什么反应。在此股价位置上，如果消费电子拐点出现，就将展开产业景气度拐点叠加国产替代的大行情。

黎明前的黑暗，继续等待。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安积极回报混合 A 份额净值为 1.628 元，本报告期诺安积极回报混合 A 份额净值增长率为-9.51%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；截至本报告期末诺安积极回报混合 C 份额净值为 1.734 元，本报告期诺安积极回报混合 C 份额净值增长率为-9.69%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在 2022 年 08 月 02 日至 2022 年 08 月 29 日期间，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 120,470,829.98 | 93.23 |
| | 其中：股票 | 120,470,829.98 | 93.23 |
| 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 | 8,637,920.78 | 6.69 |
| 8 | 其他资产 | 104,326.97 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 129,213,077.73 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 78,346,932.54 | 61.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 40,809,840.44 | 31.90 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,314,057.00 | 1.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 120,470,829.98 | 94.16 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688012 | 中微公司 | 116,465 | 12,563,079.55 | 9.82 |
| 2 | 688521 | 芯原股份 | 278,021 | 12,219,022.95 | 9.55 |
| 3 | 002371 | 北方华创 | 43,000 | 11,971,200.00 | 9.36 |
| 4 | 688037 | 芯源微 | 54,097 | 11,795,309.88 | 9.22 |
| 5 | 688256 | 寒武纪 | 185,999 | 11,658,417.32 | 9.11 |
| 6 | 688258 | 卓易信息 | 222,520 | 9,165,598.80 | 7.16 |
| 7 | 688126 | 沪硅产业 | 495,868 | 8,851,243.80 | 6.92 |
| 8 | 300782 | 卓胜微 | 93,300 | 8,248,653.00 | 6.45 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9 | 688206 | 概伦电子 | 251,109 | 7,766,801.37 | 6.07 |
| 10 | 688385 | 复旦微电 | 101,457 | 7,635,653.82 | 5.97 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 55,693.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 48,633.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 104,326.97 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 诺安积极回报混合 A | 诺安积极回报混合 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,969,624.16 | 28,460,437.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 54,021,433.01 | 33,528,559.83 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,076,143.97 | 38,818,615.61 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 53,914,913.20 | 23,170,381.42 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20220701-20220801 | 10,416,666.67 | - | 10,416,666.67 | - | - |
| 个人 | 1 | 20220701-20220801 | 6,770,833.33 | - | 6,770,833.33 | - | - |
| | 2 | 20220802-20220802 | 1,041,666.67 | - | 1,041,666.67 | - | - |
| | 3 | 20220816-20220822 | - | 1,566,579.63 | 1,566,579.63 | - | - |
| 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。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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
2022 年 10 月 26 日