

# 诺安优选回报灵活配置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：渤海银行股份有限公司

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。

基金托管人渤海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	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
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	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	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	12
§ 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	41
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	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12	投资组合报告附注 .....	54
§ 8	基金份额持有人信息 .....	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
§ 9	开放式基金份额变动 .....	55
§ 10	重大事件揭示 .....	55
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4	基金投资策略的改变 .....	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8	其他重大事件 .....	57
§ 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 .....	60
12.3	查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安优选回报混合
基金主代码	001743
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
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,188,367,579.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金通过积极配置大类资产,动态控制组合风险,并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角,综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险,并据此进行大类资产的配置与组合构建,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类金融风险收益特征的相对变化,适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资分析</p> <p>本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>4、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中,将采用积极主动的投资策略,结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种,在兼顾收益的同时,有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上,本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素,对个券进行积极的管理。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p>

	<p>本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、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	渤海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	阮劲松
	联系电话	0755-83026688	022-58316243
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	js.ruancbhb.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	400888811/95541
传真		0755-83026677	022-58314791
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	天津市河东区海河东路 218 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	天津市河东区海河东路 218 号
邮政编码		518048	300012
法定代表人		李强	李伏安

### 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	174,057,857.78
本期利润	248,627,361.00
加权平均基金份额本期利润	0.1303
本期加权平均净值利润率	7.05%
本期基金份额净值增长率	10.14%
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	328,294,529.55
期末可供分配基金份额利润	0.1500
期末基金资产净值	4,113,015,671.81
期末基金份额净值	1.879
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	134.09%

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	1.02%	0.97%	0.93%	0.51%	0.09%	0.46%
过去三个月	-0.53%	0.88%	-2.31%	0.49%	1.78%	0.39%
过去六个月	10.14%	0.86%	0.83%	0.50%	9.31%	0.36%
过去一年	13.19%	1.00%	-6.94%	0.59%	20.13%	0.41%
过去三年	78.27%	1.18%	1.42%	0.72%	76.85%	0.46%
自基金合同生	134.09%	0.85%	25.95%	0.70%	108.14%	0.15%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：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×40%。

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



## § 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		
张堃	本基金基金经理	2020 年 09 月 26 日	-	16 年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于国泰君安证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司，从事策略研究分析、中小盘研究分析工作。2014 年 5 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2015 年 8 月至 2020 年 4 月任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月起任诺安先锋混合型证券投资基金基金

					经理，2020 年 9 月起任诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 2 月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 5 月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动

按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

由于过去几年疫情对居民收入产生了较大冲击，今年消费整体上比较低迷，加上中美贸易脱钩对出口产业链的影响，与年初的强预期相比，经济复苏的力度整体上低于预期，同时居民和地方政府的高杠杆也约束了依靠地产和基建刺激经济的能力和空间。在这样的经济大背景下，上市公司盈利从大的层面上看，较难看到明显的行业性的上升趋势，这也是与前几年相比，今年并没有看到哪个大类行业出现了基本面驱动的行情的原因，而货币政策相对宽松的背景下，市场仍是存在结构性投资机会的，比如 chatgpt 相关产业链和中特估等。

在这样的经济背景下，我们的风格仍是立足于业绩和成长，并坚持了我们选择成长股的几个原则。不过客观来说，需求端的低迷还是一定程度上影响了我们部分持仓公司的业绩，对组合净值造成了一些拖累。Chatgpt 作为上半年为数不多的亮点之一，也通过我们持仓的一些 TMT 公司对我们的净值产生了一些贡献，但由于其事件驱动的特性，我们并没能做到重仓参与。AI 对实体经济的渗透，对各行业生产效率的提升，从长期看是一个比较确定的趋势，不过二级市场已经把这种预期做了一部分超前反应，因此短期内，该方向参与的性价比可能已经不是那么高了，但考虑到该赛道的远大空间和确定趋势，我们仍愿意持有一部分仓位，同时对其继续进行跟踪和观察，等待基本面的逐步跟上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.879 元，本报告期内基金份额净值增长率为 10.14%，同期业绩

比较基准收益率为 0.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内利率水平的进一步降低，以及一些鼓励大众消费政策的出台，加上工业部门整体去库存接近尾声，我们预计接下来宏观经济会环比好转，与之相关的上市公司盈利水平也将会有好转。在这个时点，市场越低，我们其实越倾向于增加一些仓位，尤其是我们长期可以很确定其增长空间，只是短期受到需求端冲击的一些公司，这类公司一旦出现修复，可以提供较好的向上的弹性。

就本基金运作而言，我们的投资组合仍保持一定程度的分散，以帮助我们在获取其增长阿尔法的同时，对冲宏观经济可能出现的各种不确定性风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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，渤海银行股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本基金托管人对本报告中财务指标、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，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：诺安优选回报灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	864,454,219.30	554,132,124.45
结算备付金		2,970,920.67	4,531,027.47
存出保证金		2,830,818.23	1,697,192.55
交易性金融资产	6.4.7.2	3,311,832,669.20	1,561,938,900.09
其中：股票投资		3,310,548,581.86	1,561,938,900.09
基金投资		-	-
债券投资		1,284,087.34	-
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	-	200,000,000.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		17,323,992.41	113,222,248.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,199,412,619.81	2,435,521,493.44
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		22,880,295.15	237,071,636.50
应付赎回款		56,864,573.34	46,205,773.81
应付管理人报酬		3,950,091.47	2,138,986.28
应付托管费		329,174.27	178,248.87
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.72	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,372,807.05	1,433,551.79
负债合计		86,396,948.00	287,028,197.25
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,188,367,579.36	1,259,192,960.74
未分配利润	6.4.7.8	1,924,648,092.45	889,300,335.45
净资产合计		4,113,015,671.81	2,148,493,296.19
负债和净资产总计		4,199,412,619.81	2,435,521,493.44

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.879 元，基金份额总额 2,188,367,579.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安优选回报灵活配置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	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

一、营业总收入		271,287,312.31	-44,009,321.30
1. 利息收入		3,664,580.37	746,055.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,609,539.28	746,055.38
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		55,041.09	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		188,123,702.24	-39,941,423.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	164,270,357.23	-43,691,986.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	773.24	-
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	23,852,571.77	3,750,562.39
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	74,569,503.22	-5,862,064.15
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	4,929,526.48	1,048,111.27
<b>减：二、营业总支出</b>		22,659,951.31	3,861,718.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,808,156.57	3,478,555.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,734,013.03	289,879.60
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		2.76	-
8. 其他费用	6.4.7.17	117,778.95	93,283.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		248,627,361.00	-47,871,039.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		248,627,361.00	-47,871,039.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		248,627,361.00	-47,871,039.71

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安优选回报灵活配置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	未分配	净资产合计

		收益	利润	
一、上期期末净资产(基金净值)	1,259,192,960.74	-	889,300,335.45	2,148,493,296.19
二、本期期初净资产(基金净值)	1,259,192,960.74	-	889,300,335.45	2,148,493,296.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	929,174,618.62	-	1,035,347,757.00	1,964,522,375.62
(一)、综合收益总额	-	-	248,627,361.00	248,627,361.00
(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)	929,174,618.62	-	786,720,396.00	1,715,895,014.62
其中: 1. 基金申购款	1,942,836,718.75	-	1,646,295,834.04	3,589,132,552.79
2. 基金赎回款	-1,013,662,100.13	-	-859,575,438.04	-1,873,237,538.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,188,367,579.36	-	1,924,648,092.45	4,113,015,671.81
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)	196,788,538.73	-	166,079,568.84	362,868,107.57
二、本期期初净资产(基金净值)	196,788,538.73	-	166,079,568.84	362,868,107.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	196,452,791.78	-	93,446,665.86	289,899,457.64
(一)、综合收益总额	-	-	-47,871,039.71	-47,871,039.71
(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)	196,452,791.78	-	141,317,705.57	337,770,497.35
其中: 1. 基金申购款	383,377,402.55	-	256,757,955.87	640,135,358.42
2. 基金赎回款	-186,924,610.77	-	-115,440,250.30	-302,364,861.07
(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	393,241,330.51	-	259,526,234.70	652,767,565.21



金净值)				
------	--	--	--	--

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

诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2015〕1743号)及《关于诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函〔2016〕642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《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年9月22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1,034,170,048.07份基金份额,其中认购资金利息折合45,475.45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,基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安优选回报灵活配置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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、存托凭证、债券(国债、金融债、公司债/企业债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金为混合型基金,股票、存托凭证资产占基金资产的比例为0-95%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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	864,454,219.30

等于：本金	864,280,391.07
加：应计利息	173,828.23
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	864,454,219.30

#### 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	3,227,991,378.58	-	3,310,548,581.86	82,557,203.28	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,053,000.00	796.24	1,284,087.34	230,291.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,053,000.00	796.24	1,284,087.34	230,291.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,229,044,378.58	796.24	3,311,832,669.20	82,787,494.38	

#### 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	1,191.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,263,136.20
其中：交易所市场	2,263,136.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,478.95
合计	2,372,807.05

#### 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	1,259,192,960.74	1,259,192,960.74
本期申购	1,942,836,718.75	1,942,836,718.75
本期赎回（以“-”号填列）	-1,013,662,100.13	-1,013,662,100.13
本期末	2,188,367,579.36	2,188,367,579.36

#### 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	82,144,240.63	807,156,094.82	889,300,335.45
本期利润	174,057,857.78	74,569,503.22	248,627,361.00
本期基金份额交易产生的变动数	72,092,431.14	714,627,964.86	786,720,396.00
其中：基金申购款	176,292,001.04	1,470,003,833.00	1,646,295,834.04
基金赎回款	-104,199,569.90	-755,375,868.14	-859,575,438.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	328,294,529.55	1,596,353,562.90	1,924,648,092.45

#### 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	3,430,603.33
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	36,626.72
其他	142,309.23
合计	3,609,539.28

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	2,071,530,869.79
减：卖出股票成本总额	1,900,696,443.76
减：交易费用	6,564,068.80
买卖股票差价收入	164,270,357.23

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益—利息收入	773.24
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-
债券投资收益—赎回差价收入	-
债券投资收益—申购差价收入	-
合计	773.24

##### 6.4.7.11.2 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	23,852,571.77
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	23,852,571.77

#### 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	74,569,503.22
-- 股票投资	74,339,212.12
-- 债券投资	230,291.10
-- 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	74,569,503.22

#### 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	4,177,027.14
基金转换费收入	752,499.34
合计	4,929,526.48

#### 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	39,671.58

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	117,778.95

#### 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
渤海银行股份有限公司	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	20,808,156.57	3,478,555.05
其中：支付销售机构的客户维护费	4,050,358.77	736,013.84

注：本基金的管理费率为年费率 1.20%。

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：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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	1,734,013.03	289,879.60

注：本基金的托管费率为年费率 0.10%。

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

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
基金合同生效日(2016年09月22日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,994,604.32	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,994,604.32	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.27%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照本基金合同及招募说明书的规定执行。

##### 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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司-活期存款	864,454,219.30	3,430,603.33	169,673,807.91	706,074.11

注：本基金的上述银行存款由基金托管人渤海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	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
30129	明阳	2023年	6个月	新股锁	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-

1	电气	06月21日		定						
301292	海科新源	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股锁定	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-

301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
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	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
601500	通用股份	2023年03月24日	6个月	非公开发行锁定	3.48	4.00	4,310,344	14,999,997.12	17,241,376.00	-
60312	常青	2023年	6个月	新股锁	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-

5	科技	03月30日		定						
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
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	硕中科技	2023年04月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-



		日								
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688502	茂莱光学	2023年02月28日	6个月	新股锁定	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	智慧微	2023年05月08日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
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	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-

688593	新相微	2023年05月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年06月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
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观念，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渤海银行股份有限公司，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发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.03%（2022 年 12 月 31 日：无）。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 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 6 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、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	864,454,219.30	-	-	-	-	864,454,219.30
结算备付金	2,970,920.67	-	-	-	-	2,970,920.67
存出保证金	2,830,818.23	-	-	-	-	2,830,818.23
交易性金融资产	-	-	-	1,284,087.34	3,310,548,581.86	3,311,832,669.20
应收申购款	-	-	-	-	17,323,992.41	17,323,992.41
资产总计	870,255,958.20	-	-	1,284,087.34	3,327,872,574.27	4,199,412,619.81
负债						

应付清算款	-	-	-	-	22,880,295.15	22,880,295.15
应付赎回款	-	-	-	-	56,864,573.34	56,864,573.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,950,091.47	3,950,091.47
应付托管费	-	-	-	-	329,174.27	329,174.27
应交税费	-	-	-	-	6.72	6.72
其他负债	-	-	-	-	2,372,807.05	2,372,807.05
负债总计	-	-	-	-	86,396,948.00	86,396,948.00
利率敏感度缺口	870,255,958.20	-	-	-1,284,087.34	3,241,475,626.27	4,113,015,671.81
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	554,132,124.45	-	-	-	-	554,132,124.45
结算备付金	4,531,027.47	-	-	-	-	4,531,027.47
存出保证金	1,697,192.55	-	-	-	-	1,697,192.55
交易性金融资产	-	-	-	-	1,561,938,900.09	1,561,938,900.09
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	-	200,000,000.00
应收申购款	30,007,775.00	-	-	-	83,214,473.88	113,222,248.88
资产总计	790,368,119.47	-	-	-	1,645,153,373.97	2,435,521,493.44
负债						
应付清算款	-	-	-	-	237,071,636.50	237,071,636.50
应付赎回款	-	-	-	-	46,205,773.81	46,205,773.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,138,986.28	2,138,986.28
应付托管费	-	-	-	-	178,248.87	178,248.87
其他负债	-	-	-	-	1,433,551.79	1,433,551.79
负债总计	-	-	-	-	287,028,197.25	287,028,197.25
利率敏感度缺口	790,368,119.47	-	-	-	1,358,125,176.72	2,148,493,296.19

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 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%（2022 年 12 月 31 日：无），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。本基金持有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	3,310,548,581.86	80.49	1,561,938,900.09	72.70
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	3,310,548,581.86	80.49	1,561,938,900.09	72.70

#### 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%		147,277,660.93
业绩比较基准下降 5%		-147,277,660.93	-69,796,806.67

#### 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	3,291,669,325.35	1,517,901,685.97
第二层次	865,434.18	-
第三层次	19,297,909.67	44,037,214.12
合计	3,311,832,669.20	1,561,938,900.09

##### 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

本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,310,548,581.86	78.83



	其中：股票	3,310,548,581.86	78.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,284,087.34	0.03
	其中：债券	1,284,087.34	0.03
	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	867,425,139.97	20.66
8	其他各项资产	20,154,810.64	0.48
9	合计	4,199,412,619.81	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	5,240,535.48	0.13
C	制造业	2,589,464,112.35	62.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,128,836.47	0.44
E	建筑业	7,077,542.35	0.17
F	批发和零售业	7,655,725.65	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	98,682,233.94	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	398,457,958.69	9.69
J	金融业	27,263,083.00	0.66
K	房地产业	120,129,779.43	2.92
L	租赁和商务服务业	8,023,815.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	12,368,175.37	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,417,127.27	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,016,332.00	0.15
Q	卫生和社会工作	9,974,074.86	0.24
R	文化、体育和娱乐业	649,250.00	0.02
S	综合	-	-

合计	3,310,548,581.86	80.49
----	------------------	-------

### 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	601058	赛轮轮胎	13,752,044	156,635,781.16	3.81
2	688258	卓易信息	1,726,395	115,202,338.35	2.80
3	300286	安科瑞	2,980,100	112,826,586.00	2.74
4	002230	科大讯飞	1,630,700	110,822,372.00	2.69
5	688169	石头科技	343,265	110,078,220.20	2.68
6	688503	聚和材料	1,069,561	104,282,197.50	2.54
7	002250	联化科技	9,198,564	96,216,979.44	2.34
8	002940	昂利康	4,956,426	95,212,943.46	2.31
9	688357	建龙微纳	1,449,472	93,766,343.68	2.28
10	688698	伟创电气	2,267,281	90,645,894.38	2.20
11	002050	三花智控	2,769,700	83,811,122.00	2.04
12	002236	大华股份	4,101,600	81,006,600.00	1.97
13	603181	皇马科技	7,246,543	80,726,489.02	1.96
14	002930	宏川智慧	3,543,522	80,685,995.94	1.96
15	605060	联德股份	2,866,379	78,710,767.34	1.91
16	001979	招商蛇口	5,747,581	74,890,980.43	1.82
17	300515	三德科技	4,609,949	74,312,377.88	1.81
18	688377	迪威尔	2,800,555	70,153,902.75	1.71
19	688290	景业智能	1,000,943	66,772,907.53	1.62
20	002466	天齐锂业	949,905	66,407,858.55	1.61
21	688521	芯原股份	886,634	63,766,717.28	1.55
22	300130	新国都	2,073,293	58,736,390.69	1.43
23	688551	科威尔	887,602	58,208,939.16	1.42
24	003028	振邦智能	1,292,700	54,047,787.00	1.31
25	688281	华秦科技	265,306	53,724,465.00	1.31
26	300910	瑞丰新材	1,011,873	50,897,211.90	1.24
27	688036	传音控股	343,800	50,538,600.00	1.23
28	601500	通用股份	12,111,804	49,149,347.40	1.19
29	300218	安利股份	4,933,736	46,475,793.12	1.13
30	002798	帝欧家居	6,266,064	42,421,253.28	1.03
31	000002	万科A	3,000,000	42,060,000.00	1.02
32	603112	华翔股份	3,545,455	41,694,550.80	1.01
33	002921	联诚精密	2,286,600	41,181,666.00	1.00
34	300007	汉威科技	1,844,500	39,011,175.00	0.95
35	300846	首都在线	2,400,000	36,840,000.00	0.90

36	601137	博威合金	2,268,000	35,290,080.00	0.86
37	300037	新宙邦	663,400	34,423,826.00	0.84
38	603888	新华网	950,000	31,179,000.00	0.76
39	300725	药石科技	605,484	29,323,590.12	0.71
40	605183	确成股份	1,612,920	29,193,852.00	0.71
41	688766	普冉股份	254,291	27,163,364.62	0.66
42	300902	国安达	589,300	22,069,285.00	0.54
43	688663	新风光	501,982	15,958,007.78	0.39
44	601788	光大证券	1,000,000	15,890,000.00	0.39
45	688333	铂力特	148,501	15,702,495.74	0.38
46	002595	豪迈科技	333,100	11,701,803.00	0.28
47	688618	三旺通信	172,434	11,677,230.48	0.28
48	688125	安达智能	171,989	9,347,602.15	0.23
49	603305	旭升集团	273,640	7,626,346.80	0.19
50	002492	恒基达鑫	1,248,800	7,180,600.00	0.17
51	300532	今天国际	343,300	7,058,248.00	0.17
52	000876	新希望	600,000	7,008,000.00	0.17
53	688283	坤恒顺维	104,182	6,930,186.64	0.17
54	688301	奕瑞科技	24,240	6,846,103.20	0.17
55	300795	米奥会展	162,300	6,769,533.00	0.16
56	300820	英杰电气	81,300	6,697,494.00	0.16
57	301103	何氏眼科	159,300	6,684,228.00	0.16
58	300863	卡倍亿	104,489	6,573,402.99	0.16
59	688223	晶科能源	466,409	6,557,710.54	0.16
60	688337	普源精电	108,630	6,546,043.80	0.16
61	300633	开立医疗	119,900	6,534,550.00	0.16
62	301029	怡合达	145,600	6,505,408.00	0.16
63	002967	广电计量	323,700	6,503,133.00	0.16
64	603129	春风动力	40,000	6,476,000.00	0.16
65	002865	钧达股份	42,300	6,452,019.00	0.16
66	688286	敏芯股份	99,819	6,286,600.62	0.15
67	002840	华统股份	400,000	6,256,000.00	0.15
68	688568	中科星图	76,460	6,161,146.80	0.15
69	300811	铂科新材	103,280	6,138,963.20	0.15
70	603377	东方时尚	748,300	6,016,332.00	0.15
71	301391	卡莱特	50,247	5,887,440.99	0.14
72	300525	博思软件	359,982	5,522,123.88	0.13
73	688121	卓然股份	121,584	4,547,241.60	0.11
74	300454	深信服	40,000	4,530,000.00	0.11
75	688092	爱科科技	151,400	4,522,318.00	0.11
76	002879	长缆科技	272,280	4,484,451.60	0.11

77	002946	新乳业	297,700	4,271,995.00	0.10
78	688737	中自科技	109,091	4,253,458.09	0.10
79	603279	景津装备	130,580	4,094,988.80	0.10
80	688556	高测股份	75,900	4,033,326.00	0.10
81	688073	毕得医药	51,846	3,669,659.88	0.09
82	600835	上海机电	212,300	3,647,314.00	0.09
83	603611	诺力股份	138,200	3,640,188.00	0.09
84	603990	麦迪科技	162,600	3,585,330.00	0.09
85	002007	华兰生物	152,400	3,415,284.00	0.08
86	002567	唐人神	500,000	3,325,000.00	0.08
87	301239	普瑞眼科	33,300	3,266,064.00	0.08
88	603385	惠达卫浴	412,700	3,107,631.00	0.08
89	601600	中国铝业	524,400	2,878,956.00	0.07
90	002859	洁美科技	100,000	2,770,000.00	0.07
91	002763	汇洁股份	312,000	2,764,320.00	0.07
92	002444	巨星科技	125,600	2,748,128.00	0.07
93	001965	招商公路	282,400	2,711,040.00	0.07
94	601985	中国核电	381,400	2,688,870.00	0.07
95	600886	国投电力	212,100	2,683,065.00	0.07
96	600674	川投能源	176,400	2,654,820.00	0.06
97	002429	兆驰股份	481,900	2,650,450.00	0.06
98	300179	四方达	249,100	2,640,460.00	0.06
99	300747	锐科激光	86,400	2,633,472.00	0.06
100	000997	新大陆	137,400	2,596,860.00	0.06
101	600717	天津港	578,400	2,562,312.00	0.06
102	603496	恒为科技	136,330	2,560,277.40	0.06
103	600782	新钢股份	677,400	2,513,154.00	0.06
104	600039	四川路桥	251,800	2,470,158.00	0.06
105	600177	雅戈尔	391,200	2,468,472.00	0.06
106	002138	顺络电子	100,000	2,391,000.00	0.06
107	002801	微光股份	78,500	2,124,210.00	0.05
108	603989	艾华集团	100,000	2,106,000.00	0.05
109	603688	石英股份	18,300	2,083,272.00	0.05
110	300573	兴齐眼药	9,600	2,052,480.00	0.05
111	688577	浙海德曼	42,942	2,043,180.36	0.05
112	688501	青达环保	91,500	2,035,875.00	0.05
113	301087	可孚医疗	41,100	2,026,230.00	0.05
114	688360	德马科技	90,800	2,014,852.00	0.05
115	300887	谱尼测试	50,900	2,014,622.00	0.05
116	688529	豪森股份	76,800	2,006,016.00	0.05
117	002014	永新股份	231,100	2,005,948.00	0.05

118	688338	赛科希德	36,162	2,005,182.90	0.05
119	000883	湖北能源	437,100	1,993,176.00	0.05
120	688066	航天宏图	32,680	1,990,212.00	0.05
121	600028	中国石化	311,700	1,982,412.00	0.05
122	300745	欣锐科技	44,500	1,965,565.00	0.05
123	600025	华能水电	274,500	1,957,185.00	0.05
124	600820	隧道股份	320,800	1,928,008.00	0.05
125	601006	大秦铁路	258,800	1,922,884.00	0.05
126	601169	北京银行	414,100	1,917,283.00	0.05
127	688078	龙软科技	36,878	1,901,060.90	0.05
128	600282	南钢股份	561,800	1,893,266.00	0.05
129	600828	茂业商业	510,700	1,889,590.00	0.05
130	002371	北方华创	5,900	1,874,135.00	0.05
131	600211	西藏药业	31,500	1,871,100.00	0.05
132	688580	伟思医疗	24,867	1,797,884.10	0.04
133	301101	明月镜片	43,800	1,797,114.00	0.04
134	300872	天阳科技	113,800	1,768,452.00	0.04
135	601158	重庆水务	317,300	1,764,188.00	0.04
136	601328	交通银行	294,900	1,710,420.00	0.04
137	601919	中远海控	181,400	1,705,160.00	0.04
138	603345	安井食品	11,600	1,702,880.00	0.04
139	002367	康力电梯	175,200	1,599,576.00	0.04
140	600938	中国海油	84,004	1,522,152.48	0.04
141	002600	领益智造	198,200	1,369,562.00	0.03
142	002017	东信和平	104,460	1,369,470.60	0.03
143	000157	中联重科	202,400	1,366,200.00	0.03
144	600755	厦门国贸	176,300	1,364,562.00	0.03
145	603289	泰瑞机器	121,600	1,364,352.00	0.03
146	601865	福莱特	35,200	1,355,552.00	0.03
147	600363	联创光电	36,500	1,354,150.00	0.03
148	600461	洪城环境	164,500	1,343,965.00	0.03
149	688398	赛特新材	39,200	1,338,680.00	0.03
150	002660	茂硕电源	139,000	1,338,570.00	0.03
151	002273	水晶光电	112,000	1,337,280.00	0.03
152	600202	哈空调	238,300	1,332,097.00	0.03
153	603316	诚邦股份	216,200	1,327,468.00	0.03
154	600079	人福医药	49,200	1,325,448.00	0.03
155	600150	中国船舶	40,200	1,322,982.00	0.03
156	300274	阳光电源	11,200	1,306,256.00	0.03
157	002732	燕塘乳业	60,300	1,303,686.00	0.03
158	688575	亚辉龙	70,300	1,297,035.00	0.03

159	300146	汤臣倍健	53,600	1,285,328.00	0.03
160	000030	富奥股份	253,500	1,277,640.00	0.03
161	002611	东方精工	221,500	1,271,410.00	0.03
162	600658	电子城	229,700	1,270,241.00	0.03
163	600197	伊力特	46,700	1,268,839.00	0.03
164	300452	山河药辅	72,300	1,260,912.00	0.03
165	600628	新世界	173,800	1,256,574.00	0.03
166	002461	珠江啤酒	141,200	1,243,972.00	0.03
167	600015	华夏银行	229,900	1,243,759.00	0.03
168	002099	海翔药业	143,500	1,232,665.00	0.03
169	601658	邮储银行	247,000	1,207,830.00	0.03
170	002126	银轮股份	67,600	1,196,520.00	0.03
171	688472	阿特斯	62,602	1,141,108.20	0.03
172	600612	老凤祥	15,856	1,108,017.28	0.03
173	000333	美的集团	18,400	1,084,128.00	0.03
174	601857	中国石油	144,900	1,082,403.00	0.03
175	300232	洲明科技	114,700	1,048,358.00	0.03
176	601966	玲珑轮胎	47,000	1,044,340.00	0.03
177	600694	大商股份	56,100	994,653.00	0.02
178	300378	鼎捷软件	27,700	948,725.00	0.02
179	601882	海天精工	28,300	942,390.00	0.02
180	688112	鼎阳科技	16,633	877,889.74	0.02
181	000682	东方电子	84,900	825,228.00	0.02
182	601319	中国人保	139,800	816,432.00	0.02
183	300470	中密控股	17,600	813,472.00	0.02
184	688211	中科微至	17,600	794,992.00	0.02
185	000063	中兴通讯	17,100	778,734.00	0.02
186	688082	盛美上海	6,899	761,649.60	0.02
187	603915	国茂股份	35,900	760,362.00	0.02
188	601998	中信银行	123,700	739,726.00	0.02
189	600482	中国动力	31,000	726,640.00	0.02
190	002406	远东传动	113,000	714,160.00	0.02
191	603393	新天然气	25,900	695,156.00	0.02
192	002117	东港股份	65,700	692,478.00	0.02
193	002061	浙江交科	154,620	689,605.20	0.02
194	605066	天正电气	73,200	688,812.00	0.02
195	688093	世华科技	34,300	688,058.00	0.02
196	000338	潍柴动力	55,000	685,300.00	0.02
197	000528	柳工	86,700	684,930.00	0.02
198	600511	国药股份	17,600	683,760.00	0.02
199	300429	强力新材	68,214	683,504.28	0.02

200	300577	开润股份	41,800	680,922.00	0.02
201	002782	可立克	44,500	680,405.00	0.02
202	002651	利君股份	87,100	676,767.00	0.02
203	600590	泰豪科技	94,900	676,637.00	0.02
204	600587	新华医疗	19,100	674,803.00	0.02
205	300893	松原股份	26,200	674,126.00	0.02
206	002376	新北洋	83,500	673,845.00	0.02
207	300866	安克创新	7,700	673,750.00	0.02
208	000589	贵州轮胎	120,100	672,560.00	0.02
209	300400	劲拓股份	41,700	668,868.00	0.02
210	300631	久吾高科	19,100	668,118.00	0.02
211	600529	山东药玻	24,500	666,890.00	0.02
212	300342	天银机电	61,800	665,586.00	0.02
213	002809	红墙股份	61,600	665,280.00	0.02
214	688670	金迪克	14,127	665,099.16	0.02
215	301002	崧盛股份	32,220	665,020.80	0.02
216	003816	中国广核	213,800	664,918.00	0.02
217	601228	广州港	204,500	660,535.00	0.02
218	300508	维宏股份	17,600	658,592.00	0.02
219	603798	康普顿	64,540	655,726.40	0.02
220	300088	长信科技	108,500	654,255.00	0.02
221	002683	广东宏大	22,200	653,568.00	0.02
222	600170	上海建工	242,300	651,787.00	0.02
223	600760	中航沈飞	14,480	651,600.00	0.02
224	002818	富森美	49,200	650,916.00	0.02
225	603721	中广天择	35,000	649,250.00	0.02
226	000026	飞亚达	53,800	648,828.00	0.02
227	601288	农业银行	183,600	648,108.00	0.02
228	600989	宝丰能源	51,300	646,893.00	0.02
229	600827	百联股份	48,200	644,434.00	0.02
230	688617	惠泰医疗	1,721	643,223.75	0.02
231	002287	奇正藏药	26,900	642,910.00	0.02
232	603383	顶点软件	11,600	642,872.00	0.02
233	000717	中南股份	231,200	642,736.00	0.02
234	600018	上港集团	122,200	641,550.00	0.02
235	601939	建设银行	102,400	641,024.00	0.02
236	002314	南山控股	194,000	640,200.00	0.02
237	603027	千禾味业	30,200	637,824.00	0.02
238	000869	张裕 A	20,800	637,728.00	0.02
239	688278	特宝生物	14,500	636,695.00	0.02
240	002133	广宇集团	187,800	636,642.00	0.02

241	002152	广电运通	54,300	636,396.00	0.02
242	603043	广州酒家	22,500	635,850.00	0.02
243	002557	洽洽食品	15,300	635,715.00	0.02
244	300388	节能国祯	94,700	635,437.00	0.02
245	600900	长江电力	28,800	635,328.00	0.02
246	600332	白云山	19,900	634,412.00	0.02
247	000818	航锦科技	19,000	634,030.00	0.02
248	000031	大悦城	172,600	631,716.00	0.02
249	600803	新奥股份	33,100	628,238.00	0.02
250	601992	金隅集团	288,100	628,058.00	0.02
251	601997	贵阳银行	121,600	627,456.00	0.02
252	300245	天玑科技	65,400	624,570.00	0.02
253	600600	青岛啤酒	6,000	621,780.00	0.02
254	600756	浪潮软件	37,400	621,588.00	0.02
255	600054	黄山旅游	48,300	618,240.00	0.02
256	688687	凯因科技	20,934	617,553.00	0.02
257	601318	中国平安	13,300	617,120.00	0.02
258	600420	国药现代	54,600	616,434.00	0.01
259	600350	山东高速	96,100	612,157.00	0.01
260	002027	分众传媒	88,600	603,366.00	0.01
261	601229	上海银行	104,800	602,600.00	0.01
262	601077	渝农商行	167,500	601,325.00	0.01
263	600933	爱柯迪	25,600	596,224.00	0.01
264	002563	森马服饰	90,900	565,398.00	0.01
265	000651	格力电器	14,300	522,093.00	0.01
266	002937	兴瑞科技	21,200	521,520.00	0.01
267	688768	容知日新	6,368	508,612.16	0.01
268	002755	奥赛康	55,000	483,450.00	0.01
269	000807	云铝股份	34,500	439,185.00	0.01
270	300796	贝斯美	34,460	414,553.80	0.01
271	600276	恒瑞医药	8,500	407,150.00	0.01
272	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
273	600008	首创环保	133,500	384,480.00	0.01
274	300047	天源迪科	46,200	376,068.00	0.01
275	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.01
276	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
277	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.01
278	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
279	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.01
280	688410	山外山	4,853	254,782.50	0.01
281	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.01



282	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.01
283	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.01
284	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.00
285	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.00
286	001332	锡装股份	4,805	186,962.55	0.00
287	688361	中科飞测	2,313	176,761.59	0.00
288	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.00
289	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.00
290	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.00
291	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.00
292	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.00
293	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.00
294	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.00
295	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
296	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
297	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
298	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.00
299	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
300	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.00
301	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.00
302	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
303	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
304	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
305	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
306	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
307	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
308	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
309	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
310	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
311	688420	美腾科技	2,408	93,261.84	0.00
312	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
313	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
314	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.00
315	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.00
316	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
317	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.00
318	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
319	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
320	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
321	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
322	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00

323	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
324	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
325	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
326	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
327	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
328	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
329	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
330	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
331	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
332	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
333	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
334	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
335	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
336	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
337	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
338	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
339	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
340	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
341	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
342	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
343	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
344	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
345	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
346	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
347	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
348	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
349	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
350	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
351	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
352	301335	天元宠物	588	14,017.92	0.00
353	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
354	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
355	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
356	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
357	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
358	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
359	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
360	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
361	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
362	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
363	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00

364	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
365	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
366	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
367	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
368	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
369	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
370	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
371	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
372	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
373	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
374	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
375	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
376	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
377	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
378	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
379	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
380	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
381	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	002230	科大讯飞	147,158,674.86	6.85
2	688012	中微公司	142,990,853.63	6.66
3	688521	芯原股份	129,898,025.72	6.05
4	002415	海康威视	129,558,020.30	6.03
5	001979	招商蛇口	126,024,142.70	5.87
6	688169	石头科技	121,683,138.86	5.66
7	601058	赛轮轮胎	114,328,435.82	5.32
8	300910	瑞丰新材	106,120,032.34	4.94
9	002050	三花智控	94,904,876.92	4.42
10	002236	大华股份	84,285,644.00	3.92
11	002250	联化科技	79,017,426.29	3.68
12	601339	百隆东方	75,594,421.00	3.52
13	002466	天齐锂业	70,456,708.35	3.28
14	300846	首都在线	61,419,351.00	2.86
15	300130	新国都	61,357,222.61	2.86
16	002896	中大力德	55,357,568.19	2.58
17	002912	中新赛克	55,029,462.07	2.56

18	300797	钢研纳克	54,825,575.58	2.55
19	688503	聚和材料	50,115,003.05	2.33
20	000002	万科A	48,013,070.87	2.23
21	002649	博彦科技	46,251,366.66	2.15
22	688357	建龙微纳	46,146,699.69	2.15
23	603496	恒为科技	45,922,162.50	2.14
24	601500	通用股份	45,684,346.92	2.13
25	688502	茂莱光学	43,453,706.79	2.02

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	688012	中微公司	190,955,179.70	8.89
2	002415	海康威视	134,293,366.36	6.25
3	002896	中大力德	89,951,300.72	4.19
4	688036	传音控股	82,155,473.70	3.82
5	688521	芯原股份	81,131,950.76	3.78
6	601339	百隆东方	69,529,742.55	3.24
7	002912	中新赛克	66,395,559.96	3.09
8	688372	伟测科技	61,985,315.60	2.89
9	002230	科大讯飞	58,506,684.78	2.72
10	688292	浩瀚深度	56,203,619.94	2.62
11	300797	钢研纳克	53,216,073.84	2.48
12	603496	恒为科技	50,525,317.21	2.35
13	688262	国芯科技	49,599,922.44	2.31
14	300910	瑞丰新材	46,726,546.30	2.17
15	300996	普联软件	46,616,146.24	2.17
16	002649	博彦科技	43,823,005.86	2.04
17	600703	三安光电	43,144,115.59	2.01
18	688018	乐鑫科技	43,033,272.96	2.00
19	000656	金科股份	37,597,262.28	1.75
20	001205	盛航股份	37,424,358.04	1.74

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	3,574,966,913.41
卖出股票收入(成交)总额	2,071,530,869.79

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,284,087.34	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,284,087.34	0.03

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118032	建龙转债	10,530	1,284,087.34	0.03

## 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	2,830,818.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,323,992.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,154,810.64

### 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	持有份额	占总份额

			比例		比例
102,195	21,413.65	1,610,960,997.37	73.61%	577,406,581.99	26.39%

## 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	10,667,506.10	0.4875%

## 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年09月22日）基金份额总额	1,034,170,048.07
本报告期期初基金份额总额	1,259,192,960.74
本报告期基金总申购份额	1,942,836,718.75
减：本报告期基金总赎回份额	1,013,662,100.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,188,367,579.36

## § 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、本基金基金财产的诉讼事项。本报告期内无

对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

#### 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	
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	1,880,442,050.39	33.51%	1,356,383.26	33.51%	-
西部证券	1	1,795,588,669.63	32.00%	1,295,160.45	32.00%	-
浙商证券	2	1,935,497,322.04	34.49%	1,396,053.81	34.49%	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	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

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
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	1,053,000.00	100.00%	200,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	诺安优选回报灵活配置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	《证券时报》、《上海证	2023年01月20日

	第 4 季度报告提示性公告	券报》、《中国证券报》、 《证券日报》	
5	诺安基金管理有限公司关于诺安优选回 报混合增加中国农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	《上海证券报》	2023年02月03日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金增加湘财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	《上海证券报》	2023年02月06日
7	诺安基金管理有限公司关于诺安优选回 报混合增加方正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	《上海证券报》	2023年02月10日
8	诺安基金管理有限公司关于诺安优选回 报混合增加红塔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	《上海证券报》	2023年02月14日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金增加华福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02月20日
10	诺安优选回报灵活配置混合型证券投资 基金限制代销机构机构投资者大额申购、 转换转入及定投业务的公告	《上海证券报》	2023年02月23日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金增加海通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15日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金增加国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》	2023年03月20日
13	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
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金投资通用股份非公开发行股票的公告	《上海证券报》	2023年03月28日
15	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
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基 金增加长江证券为代销机构并开通定投、	《上海证券报》、《中国 证券报》	2023年03月31日

	转换业务及参加基金费率优惠活动的公告		
17	诺安优选回报灵活配置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
18	诺安基金管理有限公司关于诺安优选回报混合增加财通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	《上海证券报》	2023年03月31日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联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04月12日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东北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04月13日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金开展基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2023年04月19日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新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04月20日
23	诺安优选回报灵活配置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
24	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
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部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04月27日
26	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
27	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
28	诺安基金管理有限公司关于诺安优选回报混合增加江海证券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	《上海证券报》	2023年06月05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。

## § 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优选回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安优选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报告期内诺安优选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。

### 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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2023 年 08 月 31 日