

诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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

报告送出日期：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12	投资组合报告附注 .....	50
§ 8	基金份额持有人信息 .....	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
§ 9	开放式基金份额变动 .....	52
§ 10	重大事件揭示 .....	52
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4	基金投资策略的改变 .....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8	其他重大事件 .....	54
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
§ 12	备查文件目录 .....	59
12.1	备查文件目录 .....	59
12.2	存放地点 .....	59
12.3	查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	诺安稳健回报混合	
基金主代码	000714	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 09 月 15 日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,093,979.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混合 C
下属分级基金的交易代码	000714	002052
报告期末下属分级基金的份额总额	11,635,920.97 份	37,458,058.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置，把握投资市场的变化趋势，力求在有效分散风险的同时获得长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策策略，结合定性分析和定量分析进行大类资产的配置。具体而言，首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，为基金带来稳健回报。</p> <p>1、大类资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的策略，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2、股票投资策略方面，本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量，将好公司与好股票有机结合，前瞻性地把握 A 股市场中存在的具有综合趋势机会的个股，进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。</p> <p>3、存托凭证投资策略方面，本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>5、权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p>

	本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎的原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。
业绩比较基准	60%沪深 300 指数+40%中证全债指数
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国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	中国证券报
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（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）	
	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混合 C
本期已实现收益	-3,717,586.27	-20,967,744.19
本期利润	-5,037,470.62	-26,460,470.41
加权平均基金份额本期利润	-0.2125	-0.2602

本期加权平均净值利润率	-15.38%	-19.36%
本期基金份额净值增长率	-5.73%	-5.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022 年 06 月 30 日)	
	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混合 C
期末可供分配利润	4,438,096.98	13,000,448.83
期末可供分配基金份额利润	0.3814	0.3471
期末基金资产净值	16,074,017.95	50,458,507.64
期末基金份额净值	1.381	1.347
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 06 月 30 日)	
	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混合 C
基金份额累计净值增长率	56.45%	18.96%

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。

4、自 2015 年 11 月 18 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 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

诺安稳健回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.52%	0.94%	5.69%	0.64%	-2.17%	0.30%
过去三个月	1.10%	1.15%	4.30%	0.86%	-3.20%	0.29%
过去六个月	-5.73%	1.00%	-4.64%	0.87%	-1.09%	0.13%
过去一年	-3.43%	0.76%	-6.44%	0.75%	3.01%	0.01%
过去三年	8.28%	0.55%	17.65%	0.76%	-9.37%	-0.21%
自基金合同生效起至今	56.45%	0.42%	76.43%	0.89%	-19.98%	-0.47%

诺安稳健回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.54%	0.93%	5.69%	0.64%	-2.15%	0.29%
过去三个月	1.13%	1.15%	4.30%	0.86%	-3.17%	0.29%
过去六个月	-5.74%	1.00%	-4.64%	0.87%	-1.10%	0.13%
过去一年	-3.44%	0.76%	-6.44%	0.75%	3.00%	0.01%
过去三年	8.07%	0.55%	17.65%	0.76%	-9.58%	-0.21%
自基金合同生效	18.96%	0.40%	28.83%	0.75%	-9.87%	-0.35%

效起至今					
------	--	--	--	--	--

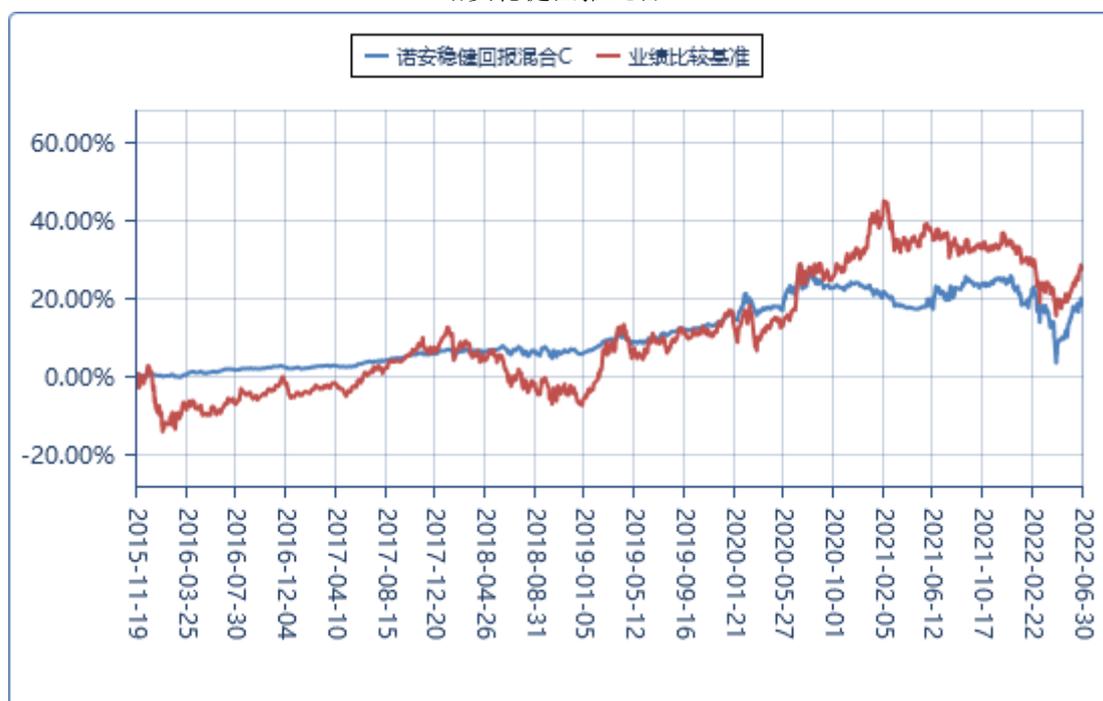
注：本基金的业绩比较基准为：60%沪深 300 指数+40%中证全债指数。

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

诺安稳健回报混合 A



诺安稳健回报混合 C



## § 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十只开放式基金：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		
郭晓晖	本基金基金经理	2021年08月11日	-	10年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于中华联合保险集团股份有限公司，从事投研工作。2017年3月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理。2018年11月起任诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年12月起任诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021年8月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年11月起任诺安聚利债券型证券投资基金基金经理，2022年1月起任诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李玉良	本基金基金经理	2021年08月11日	-	18年	博士，具有基金从业资格。曾就职于中国工商银行股份有限公司，从事内部风险管理及稽核工作。2010年6月加入诺安基金管理有限公司，历任产品经理、基金经理助理。2015年3月至2019年5月任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2016年9月至2019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，2016年9月至2020年4月

					任诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年9月至2020年9月任诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理，2016年3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，2018年7月起任诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年8月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

债券市场方面，上半年，纯债收益率呈现震荡走势。具体来看，10 年期国债上行约 4BP 至 2.82% 附近，10 年期国开债下行约 2BP 至 3.05% 附近，但期间波动幅度较大，1 月市场收益率普遍下行，2 月份开始震荡走高，持续到 3 月小幅下降后再次上行，5-6 月 V 型走势特征明显；中高等级信用债收益率曲线呈现陡峭化下移，各主要期限品种平均下行约 30 至 65BP，中短久期品种表现更优，等级利差和信用利差压缩。2022 年上半年，管理人主要参与优质的中高等级信用债和利率债的投资，优化基金组合结构和久期。

股票市场方面，上半年，A 股先抑后扬，大盘一度回撤超过 20%，4 月底各风格指数开始大幅反弹。分季度看，一季度国民经济数据好于预期，但新增社融、M2 同比等数据双双低于市场预期。随着国内疫情超预期发展，俄乌冲突、供应链断裂导致全球滞胀的担忧进一步加剧。市场情绪逐级回落。市场呈现单边下跌趋势，反弹无力。主要风格指数跌幅均达到两位数，跌幅较大的创业板跌幅接近 20%。行业方面，仅煤炭、房地产、银行等三个行业取得正收益，超过一半的行业跌幅达到两

位数，电子、国防军工等跌幅居前。二季度受国内外诸多因素影响，A股市场呈现深V走势。美联储保持紧缩政策，随着6月中旬披露的超预期通胀数据，美联储将联邦基金利率目标区间上调75个基点，这是近28年以来加息幅度首次达到75个基点，凸显美联储收紧货币政策的紧迫性。在美联储紧缩的过程中，中国央行保持宽松，4月中旬开始降准。4月份上海疫情未平，北京疫情又起，市场跌幅扩大。5月对疫情影响的预期逐步稳定，国内经济预期好转，风险资产吸引力增大，资金开始流入A股市场，市场回升。各主流风格指数均有不错表现，其中创业板指从底部反弹超过30%。

本基金采用多种手段对市场主要风格指数进行风格判断，对市场主要风格指数进行风格择时，同时注重把握行业、概念板块结构性机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安稳健回报混合A份额净值为1.381元，本报告期诺安稳健回报混合A份额净值增长率为-5.73%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%；截至本报告期末诺安稳健回报混合C份额净值为1.347元，本报告期诺安稳健回报混合C份额净值增长率为-5.74%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场方面，展望下半年，疫情反复下的经济恢复依然为主线特征，今年地方债发行前置，基建投资或维持高位，受制于房企自身流动性压力以及部分地区断供问题，地产投资压力较大，制造业投资在出口链条和盈利等因素影响下恢复力度仍需观察，消费在居民储蓄倾向抬升以及当前较高失业率情况下拉动作用可能有限，外贸形势需要关注海外持续加息对全球经济需求端的影响。整体来看，下一阶段经济恢复动能面临考验。猪价回升叠加原油处于高位，或推动CPI温和抬升，但尚不足以对货币政策构成制约，流动性大概率保持合理充裕，海外方面关注未来美联储操作的节奏和力度变化。总体来看，市场影响因素多空交织，债券市场或维持震荡走势。

股票市场方面，我们预计下半年中国经济会从低位回升，GDP增速在5.5%的潜在增速左右，叠加上半年2.5%的增速，全年实现4%左右的增速。政策方面以维稳为主，更有针对性，预计不会有太激进的政策出台，要为明后年各种潜在的困难环境预留出政策空间。房地产方面，压实地方政府责任，“保交楼、稳民生”的要求有望遏制住近期的断贷风波，防止风险进一步向金融系统蔓延。下半年的权益市场大概率仍以结构性机会为主，看好业绩超预期个股的相对收益。

#### 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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，

日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### 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

在 2022 年 05 月 13 日至 2022 年 06 月 24 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 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，不存在任何损害基金份额持有人利益的

行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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 2022 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：诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,133,450.55	38,069,186.07
结算备付金		248,838.31	1,730,809.64
存出保证金		68,717.17	43,096.27
交易性金融资产	6.4.7.2	52,797,465.00	301,067,309.96
其中：股票投资		49,359,305.82	124,534,222.06
基金投资		-	-
债券投资		3,438,159.18	176,533,087.90
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	-	30,800,000.00
应收清算款		-	1,096,339.06
应收股利		-	-
应收申购款		12,656,352.70	149.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,086,674.96
资产总计		85,904,823.73	374,893,565.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		18,907,526.97	28,926,971.72
应付赎回款		18,236.10	43,154.83
应付管理人报酬		17,275.07	239,745.85
应付托管费		7,197.95	99,894.08
应付销售服务费		1,711.95	23,819.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	32,730.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	420,350.10	971,014.38
负债合计		19,372,298.14	30,337,330.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	49,093,979.78	239,560,486.83
未分配利润	6.4.7.8	17,438,545.81	104,995,747.97
净资产合计		66,532,525.59	344,556,234.80
负债和净资产总计		85,904,823.73	374,893,565.74

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，诺安稳健回报混合 A 基金份额净值 1.381 元，基金份额总额 11,635,920.97 份；诺安稳健回报混合 C 基金份额净值 1.347 元，基金份额总额 37,458,058.81 份。诺安稳健回报混合份额总额合计为 49,093,979.78 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”项目的“本期末”余额列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-30,605,709.00	85,866.47
1. 利息收入		182,664.77	14,883.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	59,760.62	8,269.57
债券利息收入		-	6,613.87
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		122,904.15	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,156,852.42	-42,268.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-25,688,897.99	-51,859.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,392,790.53	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	139,255.04	9,591.05
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,812,610.57	111,825.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	181,089.22	1,425.72
<b>减：二、营业总支出</b>		892,232.03	86,598.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	511,809.27	18,457.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	213,253.84	7,690.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,866.04	128.98
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,522.41	-
8. 其他费用	6.4.7.18	95,780.47	60,320.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-31,497,941.03	-732.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-31,497,941.03	-732.14
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-31,497,941.03	-732.14

注：以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	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）	239,560,486.83	-	104,995,747.97	344,556,234.80
二、本期期初净资产（基金净值）	239,560,486.83	-	104,995,747.97	344,556,234.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-190,466,507.05	-	-87,557,202.16	-278,023,709.21
（一）、综合收益总额	-	-	-31,497,941.03	-31,497,941.03
（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）	-190,466,507.05	-	-56,059,261.13	-246,525,768.18
其中：1. 基金申购款	38,653,208.10	-	13,422,151.45	52,075,359.55
2. 基金赎回款	-229,119,715.15	-	-69,481,412.58	-298,601,127.73
（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）	49,093,979.78	-	17,438,545.81	66,532,525.59
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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）	4,608,594.27	-	1,975,222.91	6,583,817.18
二、本期期初净资产（基金净值）	4,608,594.27	-	1,975,222.91	6,583,817.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-189,126.78	-	-82,106.66	-271,233.44
（一）、综合收益总额	-	-	-732.14	-732.14
（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）	-189,126.78	-	-81,374.52	-270,501.30
其中：1. 基金申购款	785,509.51	-	317,706.47	1,103,215.98
2. 基金赎回款	-974,636.29	-	-399,080.99	-1,373,717.28
（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）	4,419,467.49	-	1,893,116.25	6,312,583.74

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	薛有为
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

诺安稳健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”）《关于核准诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2014〕626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《诺安稳健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2014年9月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为637,203,715.37份基金份额，其中认购资金利息折合163,064.29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《诺安基金管理有限公司关于诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金新增基金份额类别并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》，自2015年11月18日起，本基金设两级基金份额：A类基金份额和C类基金份额，A类基金份额的基金代码为000714（与分级前基金代码相同）。新设C类基金份额代码为002052。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安稳健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、权证、股指期货等权益类金融工具，国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、资产支持证券等固定收益类金融工具，短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的资产配置比例范围为：股票、存托凭证投资比例范围为基金资产的0-95%，除股票、存托凭证外的其他资产投资比例范围为5%-100%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%，每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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发布的相关规定和指引。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下文变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

##### (2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外,本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也

没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

### 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

##### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 38,069,186.07 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,580.80 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 38,071,766.87 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,730,809.64 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 778.80 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,731,588.44 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 43,096.27 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 19.40 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 43,115.67 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 30,800,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 250.52 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账

面价值为人民币 30,800,250.52 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,086,674.96 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,580.80 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 778.80 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 19.40 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 2,083,045.44 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 250.52 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 301,067,309.96 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,083,045.44 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 303,150,355.40 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。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 2022 年 06 月 30 日
活期存款	20,133,450.55
等于：本金	20,132,831.26
加：应计利息	619.29
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	20,133,450.55

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	47,990,926.87	-	49,359,305.82	1,368,378.95	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,404,739.00	33,059.18	3,438,159.18	361.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,404,739.00	33,059.18	3,438,159.18	361.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	51,395,665.87	33,059.18	52,797,465.00	1,368,739.95	

#### 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
	2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	336,655.57
其中：交易所市场	335,693.22
银行间市场	962.35
应付利息	-
预提费用	83,683.76
合计	420,350.10

### 6.4.7.7 实收基金

诺安稳健回报混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,753,403.86	61,753,403.86
本期申购	1,316,934.03	1,316,934.03
本期赎回（以“-”号填列）	-51,434,416.92	-51,434,416.92
本期末	11,635,920.97	11,635,920.97

诺安稳健回报混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	177,807,082.97	177,807,082.97
本期申购	37,336,274.07	37,336,274.07
本期赎回（以“-”号填列）	-177,685,298.23	-177,685,298.23
本期末	37,458,058.81	37,458,058.81

注：此处申购含红利再投资、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

### 6.4.7.8 未分配利润

诺安稳健回报混合 A

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
上年度末	38,228,461.65	-9,496,586.35	28,731,875.30
本期利润	-3,717,586.27	-1,319,884.35	-5,037,470.62
本期基金份额交易产生的变动数	-29,342,251.66	10,085,943.96	-19,256,307.70

其中：基金申购款	593,475.17	-98,114.58	495,360.59
基金赎回款	-29,935,726.83	10,184,058.54	-19,751,668.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,168,623.72	-730,526.74	4,438,096.98

诺安稳健回报混合 C

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
上年度末	102,887,176.74	-26,623,304.07	76,263,872.67
本期利润	-20,967,744.19	-5,492,726.22	-26,460,470.41
本期基金份额交易产生的变动数	-66,631,608.90	29,828,655.47	-36,802,953.43
其中：基金申购款	15,132,324.42	-2,205,533.56	12,926,790.86
基金赎回款	-81,763,933.32	32,034,189.03	-49,729,744.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,287,823.65	-2,287,374.82	13,000,448.83

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	25,843.86
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	12,791.58
其他	21,125.18
合计	59,760.62

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
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	571,732,645.87
减：卖出股票成本总额	595,723,092.60
减：交易费用	1,698,451.26
买卖股票差价收入	-25,688,897.99

#### 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
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益--利息收入	1,083,533.01
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	309,257.52
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	1,392,790.53

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	252,216,658.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	248,658,295.24
减：应计利息总额	3,244,796.37
减：交易费用	4,309.33
买卖债券差价收入	309,257.52

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	139,255.04
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	139,255.04

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-6,812,610.57

—股票投资	-6,644,338.72
—债券投资	-168,271.85
—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	-6,812,610.57

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	181,055.20
基金转换费收入	34.02
合计	181,089.22

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,496.71
账户维护费	18,900.00
合计	95,780.47

#### 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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	511,809.27	18,457.89
其中：支付销售机构的客户维护费	5,891.77	6,874.81

注：本基金的管理费率为年费率 0.60%。

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：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	213,253.84	7,690.76

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

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混 合 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	68,625.94	68,625.94
中国工商银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	68,625.94	68,625.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混 合 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	128.98	128.98
中国工商银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	128.98	128.98

注：本基金诺安稳健回报混合 A 份额不收取销售服务费，诺安稳健回报混合 C 份额的年销售服务费率为 0.10%。

诺安稳健回报混合 C 的销售服务费计算方法如下：

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

H 为诺安稳健回报混合 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安稳健回报混合 C 前一日的基金资产净值

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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	20,133,450.55	25,843.86	2,358,119.64	8,139.10

注：本基金的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 2022 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
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	339	18,838.23	10,180.17	-
301097	天益医疗	2022年03月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	174	9,112.38	8,322.42	-
301102	兆讯传媒	2022年03月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	211	8,414.68	6,559.99	-
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股锁定	32.61	32.02	232	7,565.00	7,428.64	-
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股锁定	23.18	16.14	515	11,939.83	8,312.10	-
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	118	7,445.80	4,702.30	-
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年04月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	798	10,956.54	12,361.02	-
301130	西点药业	2022年02月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301133	瑞德	2022年	6个月	新股锁	31.98	26.26	228	7,291.44	5,987.28	-

5	智能	04月01日		定						
301137	哈焊华通	2022年03月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	506	7,777.22	8,090.94	-
301151	冠龙节能	2022年03月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	333	10,263.06	7,146.18	-
301158	德石股份	2022年01月07日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301163	宏德股份	2022年04月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	209	8,412.25	6,393.31	-
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	152	9,740.16	5,703.04	-
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	149	11,407.44	7,736.08	-
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	151	8,588.88	8,519.42	-
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	278	8,248.26	9,251.84	-
301215	中汽股份	2022年02月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	2,967	11,274.60	18,959.13	-
301216	万凯新材	2022年03月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	229	8,170.72	6,833.36	-
301219	腾远钴业	2022年03月10日	6个月	新股锁定	96.36	87.82	65	6,263.28	5,708.30	-
301222	浙江恒威	2022年03月02日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	227	7,713.46	6,573.92	-
301228	实朴检测	2022年01月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

301236	软通动力	2022年03月08日	6个月	新股锁定	48.48	31.38	230	11,150.64	7,217.40	-
301237	和顺科技	2022年03月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	135	7,653.15	5,651.10	-
301248	杰创智能	2022年04月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	248	9,689.36	7,407.76	-
301256	华融化学	2022年03月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	952	7,663.60	9,596.16	-
301258	富士莱	2022年03月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	136	6,568.80	5,668.48	-
301259	艾布鲁	2022年04月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	416	7,650.24	10,375.04	-
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	359	7,154.87	11,265.42	-
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	293	8,350.50	10,216.91	-
301288	清研环境	2022年04月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
688046	药康生物	2022年04月14日	6个月	新股锁定	22.53	26.24	5,609	126,370.77	147,180.16	-
688163	赛伦生物	2022年03月02日	6个月	新股锁定	33.03	23.56	2,445	80,758.35	57,604.20	-
688197	首药控股	2022年03月16日	6个月	新股锁定	39.90	23.20	8,144	324,945.60	188,940.80	-
688225	亚信安全	2022年01月26日	6个月	新股锁定	30.51	21.00	3,458	105,503.58	72,618.00	-
688259	创耀科技	2022年01月05日	6个月	新股锁定	66.60	79.22	1,569	104,495.40	124,296.18	-

688267	中触媒	2022 年 02 月 09 日	6 个月	新股锁定	41.90	31.90	1,278	53,548.20	40,768.20	-
--------	-----	------------------	------	------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

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“301219 腾远钴业”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 0.8 股；“301103 何氏眼科”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 0.3 股；“301236 软通动力”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 0.5 股；“301109 军信股份”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 0.5 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%。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	9,470,550.00
A-1 以下	-	-
未评级	3,438,159.18	78,765,150.00
合计	3,438,159.18	88,235,700.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	29,124,600.00
AAA 以下	-	45,440,500.00
未评级	-	13,732,287.90
合计	-	88,297,387.90

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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 2022 年 06 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 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 2022 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融金融资产及应收申购款等生息资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	20,133,450.55	-	-	-	-	20,133,450.55
结算备付金	248,838.31	-	-	-	-	248,838.31
存出保证金	68,717.17	-	-	-	-	68,717.17
交易性金融资 产	-	3,438,159.18	-	-	49,359,305.82	52,797,465.00
应收申购款	-	-	-	-	12,656,352.70	12,656,352.70
资产总计	20,451,006.03	3,438,159.18	-	-	62,015,658.52	85,904,823.73
负债						
应付清算款	-	-	-	-	18,907,526.97	18,907,526.97
应付赎回款	-	-	-	-	18,236.10	18,236.10
应付管理人报 酬	-	-	-	-	17,275.07	17,275.07
应付托管费	-	-	-	-	7,197.95	7,197.95
应付销售服务 费	-	-	-	-	1,711.95	1,711.95
其他负债	-	-	-	-	420,350.10	420,350.10
负债总计	-	-	-	-	19,372,298.14	19,372,298.14
利率敏感度缺 口	20,451,006.03	3,438,159.18	-	-	42,643,360.38	66,532,525.59
上年度末 2021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	38,069,186.07	-	-	-	-	38,069,186.07
结算备付金	1,730,809.64	-	-	-	-	1,730,809.64
存出保证金	43,096.27	-	-	-	-	43,096.27
交易性金融资 产	73,100,187.90	54,180,300.00	49,252,600.00	-	124,534,222.06	301,067,309.96
买入返售金融 资产	30,800,000.00	-	-	-	-	30,800,000.00
应收清算款	-	-	-	-	1,096,339.06	1,096,339.06
其他资产	-	-	-	-	2,086,674.96	2,086,674.96
应收申购款	-	-	-	-	149.78	149.78

资产总计	143,743,279.88	54,180,300.00	49,252,600.00	-	127,717,385.86	374,893,565.74
负债						
应付清算款	-	-	-	-	28,926,971.72	28,926,971.72
应付赎回款	-	-	-	-	43,154.83	43,154.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	239,745.85	239,745.85
应付托管费	-	-	-	-	99,894.08	99,894.08
应付销售服务费	-	-	-	-	23,819.81	23,819.81
应交税费	-	-	-	-	32,730.27	32,730.27
其他负债	-	-	-	-	971,014.38	971,014.38
负债总计	-	-	-	-	30,337,330.94	30,337,330.94
利率敏感度缺口	143,743,279.88	54,180,300.00	49,252,600.00	-	97,380,054.92	344,556,234.80

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2022年06月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	市场利率下降 27 个基点		4,962.71
市场利率上升 27 个基点		-4,962.71	-437,390.11

#### 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 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	49,359,305.82	74.19	124,534,222.06	36.14
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	49,359,305.82	74.19	124,534,222.06	36.14

#### 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(2022 年 06 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	2,895,437.84	4,507,944.80
业绩比较基准下降 5%	-2,895,437.84	-4,507,944.80	

### 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 2022 年 06 月 30 日	上年末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	48,451,693.04	123,444,214.52
第二层次	3,438,159.18	177,623,095.44
第三层次	907,612.78	-
合计	52,797,465.00	301,067,309.96

#### 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	49,359,305.82	57.46
	其中：股票	49,359,305.82	57.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,438,159.18	4.00
	其中：债券	3,438,159.18	4.00
	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	20,382,288.86	23.73
8	其他各项资产	12,725,069.87	14.81
9	合计	85,904,823.73	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	2,369,842.00	3.56
C	制造业	34,557,546.34	51.94
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	11,265.42	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	595,394.00	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,859,126.76	10.31
J	金融业	2,509,430.00	3.77
K	房地产业	594,750.00	0.89
L	租赁和商务服务业	1,287,674.99	1.94
M	科学研究和技术服务业	359,010.23	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	207,837.44	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,428.64	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,359,305.82	74.19

## 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	300573	兴齐眼药	15,400	2,361,128.00	3.55
2	300604	长川科技	48,900	2,207,835.00	3.32

3	002230	科大讯飞	50,100	2,065,122.00	3.10
4	600219	南山铝业	544,600	2,009,574.00	3.02
5	600584	长电科技	62,300	1,682,100.00	2.53
6	600570	恒生电子	38,000	1,654,520.00	2.49
7	600521	华海药业	69,900	1,586,730.00	2.38
8	002304	洋河股份	8,500	1,556,775.00	2.34
9	300083	创世纪	126,500	1,454,750.00	2.19
10	002415	海康威视	37,100	1,343,020.00	2.02
11	300661	圣邦股份	7,300	1,328,746.00	2.00
12	000997	新大陆	100,500	1,327,605.00	2.00
13	601677	明泰铝业	55,500	1,320,900.00	1.99
14	000776	广发证券	70,600	1,320,220.00	1.98
15	601898	中煤能源	126,400	1,312,032.00	1.97
16	601888	中国中免	5,500	1,281,115.00	1.93
17	600416	湘电股份	66,200	1,255,152.00	1.89
18	600456	宝钛股份	20,200	1,199,880.00	1.80
19	601878	浙商证券	104,500	1,189,210.00	1.79
20	002283	天润工业	157,200	1,073,676.00	1.61
21	688665	四方光电	7,200	1,065,600.00	1.60
22	000983	山西焦煤	79,000	1,057,810.00	1.59
23	300009	安科生物	104,600	1,057,506.00	1.59
24	603392	万泰生物	6,800	1,056,040.00	1.59
25	002371	北方华创	3,800	1,053,056.00	1.58
26	600577	精达股份	187,200	1,038,960.00	1.56
27	002465	海格通信	102,500	931,725.00	1.40
28	002268	卫士通	20,000	858,200.00	1.29
29	300593	新雷能	19,880	825,218.80	1.24
30	002049	紫光国微	4,200	796,824.00	1.20
31	002402	和而泰	40,500	771,930.00	1.16
32	300351	永贵电器	45,100	753,170.00	1.13
33	300196	长海股份	39,800	751,822.00	1.13
34	002025	航天电器	9,800	684,236.00	1.03
35	002171	楚江新材	71,100	663,363.00	1.00
36	601222	林洋能源	77,600	647,960.00	0.97
37	300910	瑞丰新材	9,700	613,234.00	0.92
38	300451	创业慧康	82,900	596,880.00	0.90
39	002120	韵达股份	34,900	595,394.00	0.89
40	600641	万业企业	30,500	594,750.00	0.89
41	603185	上机数控	2,400	374,376.00	0.56
42	301215	中汽股份	29,665	204,243.25	0.31
43	688197	首药控股	8,144	188,940.80	0.28

44	688046	药康生物	5,609	147,180.16	0.22
45	688259	创耀科技	1,569	124,296.18	0.19
46	301259	艾布鲁	4,152	120,213.44	0.18
47	301268	铭利达	2,928	111,400.91	0.17
48	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.16
49	301212	联盛化学	2,772	103,624.80	0.16
50	300834	星辉环材	3,386	102,382.39	0.15
51	301109	军信股份	5,145	87,624.00	0.13
52	301248	杰创智能	2,476	80,352.48	0.12
53	301236	软通动力	2,282	74,830.80	0.11
54	688225	亚信安全	3,458	72,618.00	0.11
55	301216	万凯新材	2,285	71,700.16	0.11
56	301135	瑞德智能	2,278	64,822.28	0.10
57	301237	和顺科技	1,348	59,993.50	0.09
58	301219	腾远钴业	648	59,624.14	0.09
59	688163	赛伦生物	2,445	57,604.20	0.09
60	688267	中触媒	1,278	40,768.20	0.06
61	301120	新特电气	798	12,361.02	0.02
62	301116	益客食品	577	11,805.42	0.02
63	301263	泰恩康	359	11,265.42	0.02
64	301256	华融化学	952	9,596.16	0.01
65	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.01
66	301130	西点药业	237	8,934.90	0.01
67	301207	华兰疫苗	151	8,519.42	0.01
68	301097	天益医疗	174	8,322.42	0.01
69	301137	哈焊华通	506	8,090.94	0.01
70	301200	大族数控	149	7,736.08	0.01
71	301158	德石股份	379	7,724.02	0.01
72	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.01
73	301103	何氏眼科	232	7,428.64	0.01
74	301151	冠龙节能	333	7,146.18	0.01
75	301222	浙江恒威	227	6,573.92	0.01
76	301102	兆讯传媒	211	6,559.99	0.01
77	301181	标榜股份	209	6,393.31	0.01
78	301196	唯科科技	152	5,703.04	0.01
79	301258	富士莱	136	5,668.48	0.01
80	301110	青木股份	118	4,702.30	0.01

#### 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	000002	万 科 A	12,508,948.00	3.63
2	600276	恒瑞医药	10,109,380.71	2.93
3	000651	格力电器	8,730,840.00	2.53
4	300841	康华生物	8,468,705.00	2.46
5	000960	锡业股份	8,453,503.00	2.45
6	002258	利尔化学	8,297,098.57	2.41
7	600887	伊利股份	8,063,563.00	2.34
8	002120	韵达股份	8,032,100.85	2.33
9	300558	贝达药业	7,687,960.50	2.23
10	002466	天齐锂业	7,479,225.00	2.17
11	002352	顺丰控股	7,327,208.00	2.13
12	601238	广汽集团	7,197,326.37	2.09
13	600315	上海家化	7,190,884.00	2.09
14	603799	华友钴业	6,988,550.93	2.03
15	600233	圆通速递	6,917,015.34	2.01
16	601001	晋控煤业	6,834,934.00	1.98
17	300073	当升科技	6,684,848.37	1.94
18	002025	航天电器	6,482,738.25	1.88
19	600546	山煤国际	6,018,913.00	1.75
20	600967	内蒙一机	5,981,662.00	1.74

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	000002	万 科 A	11,979,642.05	3.48
2	002352	顺丰控股	9,644,046.00	2.80
3	603713	密尔克卫	9,535,098.38	2.77
4	600276	恒瑞医药	8,785,598.40	2.55
5	000960	锡业股份	8,718,813.00	2.53
6	000651	格力电器	8,596,452.00	2.49
7	600760	中航沈飞	8,566,106.00	2.49
8	002258	利尔化学	8,414,038.80	2.44
9	600887	伊利股份	8,347,511.00	2.42
10	601001	晋控煤业	7,691,882.00	2.23
11	300260	新莱应材	7,524,362.00	2.18
12	601238	广汽集团	7,239,777.00	2.10
13	600456	宝钛股份	7,151,485.00	2.08
14	000977	浪潮信息	7,042,639.00	2.04

15	603799	华友钴业	6,949,481.45	2.02
16	600873	梅花生物	6,922,070.80	2.01
17	300558	贝达药业	6,755,975.52	1.96
18	002120	韵达股份	6,754,834.00	1.96
19	600399	抚顺特钢	6,747,841.00	1.96
20	600233	圆通速递	6,635,197.18	1.93

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	527,192,515.08
卖出股票收入（成交）总额	571,732,645.87

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	3,438,159.18	5.17
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,438,159.18	5.17

#### 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	019666	22 国债 01	34,000	3,438,159.18	5.17

#### 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，除创世纪外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

广东创世纪智能装备集团股份有限公司在报告编制日前一年内受到广东证监局的行政监管措施。

截至本报告期末，创世纪（300083）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司估值较低，有恢复增长的潜力，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有创世纪。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	68,717.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,656,352.70

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,725,069.87

#### 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

份额级别	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
诺安稳健回报混合 A	265	43,909.14	8,110,638.56	69.70%	3,525,282.41	30.30%
诺安稳健回报混合 C	15	2,497,203.92	37,333,401.75	99.67%	124,657.06	0.33%
合计	280	175,335.64	45,444,040.31	92.57%	3,649,939.47	7.43%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	诺安稳健回报混合 A	70,862.09	0.6090%
	诺安稳健回报	121,903.77	0.3254%

	混合 C		
	合计	192,765.86	0.3926%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	诺安稳健回报混合 A	0
	诺安稳健回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安稳健回报混合 A	0
	诺安稳健回报混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安稳健回报混合 A	诺安稳健回报混合 C
基金合同生效日（2014 年 09 月 15 日）基金份额总额	637,203,715.37	-
本报告期期初基金份额总额	61,753,403.86	177,807,082.97
本报告期基金总申购份额	1,316,934.03	37,336,274.07
减：本报告期基金总赎回份额	51,434,416.92	177,685,298.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	11,635,920.97	37,458,058.81

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。

## § 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，王学明先生担任公司董事、赵忆波先生不再担任公司董事，于东升先生不再担任

公司副总经理。

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

本报告期内，因未按期完成境外子公司股权架构简化工作，中国证监会责令公司改正，公司将继续加紧推进。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
信达证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
招商证券	1	554,293,424.60	50.71%	515,789.17	50.69%	-
中信建投	1	538,801,238.72	49.29%	501,778.98	49.31%	-
中信证券 (华南)	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 3 个交易单元：国元证券股份有限公司（1 个交易单元）、信达证券股份有限公司（2 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
  - （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
  - （3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
  - （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
  - （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
  - （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,192,294.40	5.44%	46,000,000.00	5.69%	-	-	-	-
中信建投	90,274,375.97	94.56%	762,700,000.00	94.31%	-	-	-	-
中信证券（华南）	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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公司旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年01月01日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万得基金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》	2022年01月14日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长量基金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》	2022年01月14日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加普益基金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》	2022年01月21日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加同花顺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》	2022年01月21日
6	诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022年01月24日
7	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年01月24日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加攀赢基金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》	2022年01月28日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中植基金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》	2022年01月28日
10	诺安基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022年01月31日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业开展的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》	2022年02月10日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富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》	2022年02月11日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国美基金为代销机构并开通定投、	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2022年02月18日

	转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券日报》	
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承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》	2022年02月25日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加度小满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》	2022年03月04日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加西部证券开展的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》	2022年03月10日
17	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》	2022年03月11日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通定投、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》	2022年03月15日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰基金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》	2022年03月15日
20	诺安基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	《上海证券报》	2022年03月18日
21	诺安基金管理有限公司关于开通平安银行借记卡直销网上交易业务并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》	2022年03月22日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息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》	2022年03月30日
23	诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022年03月31日
24	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年03月31日
25	诺安基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月01日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海证券开展的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》	2022年04月08日

27	诺安基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月14日
28	诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022年04月22日
29	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2022年04月22日
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇成基金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》	2022年04月22日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加雪球基金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》	2022年04月22日
32	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商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》、《证券日报》	2022年04月29日
33	诺安基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月29日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米基金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》	2022年05月13日
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富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》	2022年05月18日
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华龙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》	2022年05月27日
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发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》	2022年05月30日
38	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富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》	2022年06月15日
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、《上海证	2022年06月15日

	金增加华宝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	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
40	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆享基金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》	2022年06月15日
41	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加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》	2022年06月17日
42	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金财富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》	2022年06月24日
43	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州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》、《证券日报》	2022年06月29日

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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220119-20220428	42,492,209.63	-	42,492,209.63	-	-
	2	20220215-20220321	35,893,036.61	-	35,893,036.61	-	-
	3	20220322-20220512	35,260,225.67	-	35,260,225.67	-	-
	4	20220429-20220627	14,305,436.34	-	14,305,436.34	-	-
	5	20220513-20220626	6,877,303.99	-	-	6,877,303.99	14.01%
	6	20220628-20220628	6,877,303.99	-	-	6,877,303.99	14.01%
	7	20220627-20220627	-	21,199,680.00	-	21,199,680.00	43.18%

		30		1		1	
个人							
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## 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稳健回报灵活配置混合型证券投资基金公开募集的文件。
- ② 《诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③ 《诺安稳健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 报告期内诺安稳健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  
2022 年 08 月 31 日