

# 诺安主题精选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
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	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46

7.12	投资组合报告附注 .....	46
§ 8	基金份额持有人信息 .....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
§ 9	开放式基金份额变动 .....	47
§ 10	重大事件揭示 .....	47
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	49
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§ 12	备查文件目录 .....	51
12.1	备查文件目录 .....	52
12.2	存放地点 .....	52
12.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安主题精选混合型证券投资基金
基金简称	诺安主题精选混合
基金主代码	320012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 09 月 15 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	119,801,089.70 份
基金合同存续期	不定期

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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	诺安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	021-60637111
传真	0755-83026677	021-60635778
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李强	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-50,232,711.75
本期利润	-36,622,503.82
加权平均基金份额本期利润	-0.3543
本期加权平均净值利润率	-12.05%
本期基金份额净值增长率	-11.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	253,298,795.10
期末可供分配基金份额利润	2.1143
期末基金资产净值	373,099,884.80
期末基金份额净值	3.114
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	241.72%

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	13.48%	1.33%	7.15%	0.80%	6.33%	0.53%
过去三个月	12.95%	1.48%	5.04%	1.07%	7.91%	0.41%
过去六个月	-11.00%	1.46%	-6.34%	1.09%	-4.66%	0.37%
过去一年	-26.82%	1.40%	-9.34%	0.93%	-17.48%	0.47%
过去三年	59.37%	1.43%	17.77%	0.95%	41.60%	0.48%
自基金合同生效起至今	241.72%	1.37%	63.34%	1.07%	178.38%	0.30%

注:本基金的业绩比较基准为:75%沪深300指数+25%中证全债指数。

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 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		
罗春蕾	本基金基金经理	2015 年 09 月 26 日	-	15 年	硕士, 具有基金从业资格。曾先后任职于中信证券股份有限公司、长盛基金管理有限公司、银华基金管理有限公司, 从事医药行业研究工作。2011 年 12 月加入诺安基金管理有限公司, 历任研究员。2019 年 2 月至 2020 年 4 月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 6 月至 2020 年 5 月任诺安鸿鑫混合型证券投资基金基金经理。2015 年 9 月起任诺安主题精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任诺安积极配置混合型证券投资基金基金经理。

注: ①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，市场呈现先跌后涨的走势。前四个月，一是国内疫情此起彼伏，尤其是 3-4 月份深圳、吉林、上海等地先后出现大规模疫情，对民众的正常生活、相当多的线下店铺、实体企业的经营构成不小影响；二是俄乌战争推高了中短期全球的能源、大宗商品价格，带来较大通胀压力，也令中国面临了一部分海外的地缘政治压力。因此投资者信心颇受打击，市场一路下行。进入 5 月份，一方面是国内疫情逐步得到控制，每日新增病例逐步减少；一方面是经济问题日益突出，政府重视程度越来越高，相继出台多个提振经济的政策，并且我们也逐渐能从各种宏观数据中看到经济的触底回升；还有一方面则是海外股市走熊，国际资本对美股的担忧加剧，相比之下 A 股的吸引力加大，之前一度有所流出的海外资金再度回流 A 股。在这几方面的作用下，市场开始反弹，且呈现单边上

涨行情。

从上半年的市场结构来看，受益于上游涨价的煤炭板块涨幅最高（中信煤炭涨幅达到 33.4%，以下涉及行业指数的皆用中信指数），有疫情改善、经济复苏预期的消费者服务、交运等涨幅在 10% 以内。科技成长板块里的电子、计算机、通信、军工等则跌幅居前。大消费板块中，除了消费者服务指数上涨，食品饮料、家电、零售、纺服、轻工等，均有不同程度下跌。医药指数跌幅则达到 13.8%，比大消费跌的更多。

本基金一直以来专注大消费及医药的投资。这两大类板块在过去一年到一年半的时间里，市场热情都比较低迷。一来是众多公司业绩受到疫情影响，低于预期；二是估值回落，股价承压。所以过去一段时间，本基金的业绩亦不太理想，尤其在今年一季度回撤较大，恐令投资人承受了阶段性的浮亏。进入二季度，随着市场的反弹以及风格切换等因素，本基金的净值也逐渐有了起色，全季收益率强于中小板、创业板、上证 50 等大部分指数（5-7%的收益率），也强于本基金的业绩基准的收益率。从整个上半年来看，本基金净值处于下跌状态，跑输本基金的业绩基准，强于中小板、创业板、科创 50、中证 500 及中证 1000 等中小盘成长股指数，但弱于上证综指、上证 50、沪深 300 等大盘股指数。

在过去近一年半的时间里，市场整体的风格都不是很利于大消费及医药板块的投资。这其中既有行业基本面欠佳的因素——大消费受疫情拖累，医药既受疫情拖累，也受降价拖累；也有对板块前期高估值不断消化的因素。但我们依然能看到，虽然市场避免不了波动，但一些细分产业的发展却势头不减。故本基金的策略是对依然保有核心竞争力的龙头公司长期持有，对产业景气度处于高位的优质中小公司在市场低谷时逐步布局，努力寻找下一轮医药及大消费牛市的领跑公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 3.114 元，本报告期内基金份额净值增长率为-11.00%，同期业绩比较基准收益率为-6.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在一季报的投资分析中，我们曾经提到从过去十几年 A 股的经验看，沪深两市的市值/GDP 有一个大致区间，历史上最悲观的熊市里，市值可跌至 GDP 的 50%甚至更低（且那时中国的证券化率还比较低，石油、电信等很多大企业未上市，互联网公司又多在香港和海外上市），所以我们判断随着近年来国内证券化率的提升，即使再度遭遇熊市，市值/GDP 大概率也不会低于这一的水平。随后在今年 4 月份，随着市场继续下行，上证最低点时两市市值低至 GDP 的 65%。之后随着疫情改善，A 股触底回升。所以在接下来的环境里，只要国内不再出现类似上海这种超一线城市需要全市封城的

大规模疫情，各地能够通过核酸常态化来把疫情病例数量严控到不至于明显蔓延，那我们认为市场在政策面、情绪面上可能都已经接近低位了。至于经济面，从短期看的确已经随着疫情的改善而触底了。但从中期角度，能源价格仍处高位，国内 PPI 也处在从高点回落的过程中（意味着上游原材料的价格已经有所回落，但仍然同比是增长的），且国内工业库存仍在高位，还未开始经历去库存的阶段。以上种种，我们认为就国内经济而言，下行通道可能仍未走完。至于以美国为代表的海外需求，无论制造业库存、商业库存还是 PPI，几乎都在高位，从一些中观行业的跟踪看，美国一些零售商及 to C 端产品的公司，已经在不同程度下调供应链订单，我们认为美国的经济可能正处在从高景气到开始回落的初期。这意味着接下来一段时间，我们可能会面临国内、国外双双处于经济下行通道的阶段，经济压力可能不小，疫情改善带来的向上动力未必能抵消这股向下的压力。因此，经济面的寻底过程或许还将继续。

二季度的市场反弹从 4 月末最低点开始至季度末，以中小板、创业板、中证 1000 为代表的先锋，反弹幅度已经近 30%，反弹力度较弱的上证 50 也有 14% 的涨幅了。应该说这一波的整体反弹力度是比较强的。上证指数已经把上海疫情以来的下跌都涨回去了。那么接下来，市场反应的就不仅仅是疫情后的各种复苏现象了，而应回归到中期的经济运行轨道、企业实际经营状况来。因此第三季度的业绩情况可能对市场走势影响较大。

#### 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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：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	71,554,709.42	54,697,730.04
结算备付金		348,790.63	743,585.13
存出保证金		122,015.28	165,726.55
交易性金融资产	6.4.7.2	298,287,891.76	323,557,988.51
其中：股票投资		298,287,891.76	323,557,988.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	25,900,000.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,121,708.65	125,131.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,829.03
资产总计		376,435,115.74	405,194,990.54
<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		584,913.04	32,302,428.73
应付赎回款		1,942,433.73	510,841.56
应付管理人报酬		384,637.82	454,304.51
应付托管费		64,106.30	75,717.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	359,140.05	703,954.41
负债合计		3,335,230.94	34,047,246.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	119,801,089.70	106,073,467.08
未分配利润	6.4.7.8	253,298,795.10	265,074,276.81
净资产合计		373,099,884.80	371,147,743.89
负债和净资产总计		376,435,115.74	405,194,990.54

注：(1) 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.114 元，基金份额总额 119,801,089.70 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”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 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”、“应付利息”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：诺安主题精选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>		-33,896,316.57	60,942,796.75
1. 利息收入		113,152.41	137,435.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	109,431.77	137,435.07
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		3,720.64	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-47,694,797.07	59,489,428.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-49,471,577.92	57,001,419.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,776,780.85	2,488,009.14
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,610,207.93	946,505.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	75,120.16	369,427.88
<b>减：二、营业总支出</b>		2,726,187.25	6,275,701.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,265,452.91	3,806,040.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	377,575.54	634,340.07
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	83,158.80	1,835,320.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-36,622,503.82	54,667,095.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-36,622,503.82	54,667,095.24
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-36,622,503.82	54,667,095.24

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：诺安主题精选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）	106,073,467.08	-	265,074,276.81	371,147,743.89
二、本期期初净资产（基金净值）	106,073,467.08	-	265,074,276.81	371,147,743.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,727,622.62	-	-11,775,481.71	1,952,140.91
（一）、综合收益总额	-	-	-36,622,503.82	-36,622,503.82
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	13,727,622.62	-	24,847,022.11	38,574,644.73
其中：1. 基金申购款	36,220,137.08	-	69,108,107.99	105,328,245.07
2. 基金赎回款	-22,492,514.46	-	-44,261,085.88	-66,753,600.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	119,801,089.70	-	253,298,795.10	373,099,884.80
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	未分配	净资产合计



		收益	利润	
一、上期期末净资产（基金净值）	144,830,136.29	-	407,906,033.97	552,736,170.26
二、本期期初净资产（基金净值）	144,830,136.29	-	407,906,033.97	552,736,170.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,850,545.98	-	-10,815,172.00	-33,665,717.98
（一）、综合收益总额	-	-	54,667,095.24	54,667,095.24
（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）	-22,850,545.98	-	-65,482,267.24	-88,332,813.22
其中：1. 基金申购款	51,960,332.57	-	159,567,167.08	211,527,499.65
2. 基金赎回款	-74,810,878.55	-	-225,049,434.32	-299,860,312.87
（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）	121,979,590.31	-	397,090,861.97	519,070,452.28

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安主题精选混合型证券投资基金基

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值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 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 54,697,730.04 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,419.83 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

54,702,149.87 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 743,585.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 334.60 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 743,919.73 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 165,726.55 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 74.60 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 165,801.15 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 4,829.03 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 4,419.83 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 334.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 74.60 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。

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	71,554,709.42
等于：本金	71,548,303.10
加：应计利息	6,406.32
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	71,554,709.42

#### 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	287,125,053.83	-	298,287,891.76	11,162,837.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	287,125,053.83	-	298,287,891.76	11,162,837.93

#### 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	6,881.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	270,435.71
其中：交易所市场	270,435.71
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	359,140.05

#### 6.4.7.7 实收基金

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	106,073,467.08	106,073,467.08
本期申购	36,220,137.08	36,220,137.08
本期赎回（以“-”号填列）	-22,492,514.46	-22,492,514.46
本期末	119,801,089.70	119,801,089.70

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

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	327,912,921.67	-62,838,644.86	265,074,276.81
本期利润	-50,232,711.75	13,610,207.93	-36,622,503.82
本期基金份额交易产生的变动数	32,762,287.37	-7,915,265.26	24,847,022.11
其中：基金申购款	97,485,086.79	-28,376,978.80	69,108,107.99
基金赎回款	-64,722,799.42	20,461,713.54	-44,261,085.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	310,442,497.29	-57,143,702.19	253,298,795.10

#### 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	103,648.70
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	3,854.29
其他	1,928.78
合计	109,431.77

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	342,517,680.20
减：卖出股票成本总额	390,992,609.05
减：交易费用	996,649.07
买卖股票差价收入	-49,471,577.92

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 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。

## 6.4.7.15 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	1,776,780.85
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	1,776,780.85

## 6.4.7.16 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	13,610,207.93
-- 股票投资	13,610,207.93
-- 债券投资	-
-- 资产支持证券投资	-
-- 基金投资	-
-- 贵金属投资	-
-- 其他	-
2. 衍生工具	-
-- 权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	13,610,207.93

## 6.4.7.17 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	74,231.93
基金转换费收入	888.23
合计	75,120.16

## 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

## 6.4.7.19 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	22,315.49

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,335.94
合计	83,158.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	2,265,452.91	3,806,040.68
其中：支付销售机构的客户维护费	801,353.18	1,100,599.91

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	377,575.54	634,340.07

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行股份有限公司	71,554,709.42	103,648.70	52,368,569.32	127,004.43

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末 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	263	14,614.91	7,897.89	-
301097	天益医疗	2022年03月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	209	10,945.33	9,996.47	-
301102	兆讯传媒	2022年03月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	280	11,166.40	8,705.20	-
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股锁定	32.67	32.02	307	10,030.00	9,830.14	-
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股锁定	23.19	16.14	662	15,351.21	10,684.68	-
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	158	9,969.80	6,296.30	-
301112	信邦智能	2022年06月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
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	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年05月27日	6个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	296	9,466.08	7,772.96	-
301136	招标股份	2021年12月31日	6个月	新股锁定	10.52	19.74	7,172	75,449.44	141,575.28	-
301137	哈焊华通	2022年03月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022年03月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	389	11,988.98	8,347.94	-
301155	中科	2022年	6个月	新股锁	33.68	43.98	308	10,373.44	13,545.84	-

3	江南	05月10日		定							
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	-	
301160	翔楼新材	2022年05月25日	6个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-	
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	-	
301175	中科环保	2022年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	35,636	136,129.52	136,129.52	-	
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股锁定	3.82	3.82	3,960	15,127.20	15,127.20	-	
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	117	7,497.36	4,389.84	-	
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	200	15,312.00	10,384.00	-	
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	189	10,750.32	10,663.38	-	
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	356	10,562.52	11,847.68	-	
301215	中汽股份	2022年02月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,116	15,640.80	26,301.24	-	
301216	万凯新材	2022年03月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	280	9,990.40	8,355.20	-	
301219	腾远钴业	2022年03月10日	6个月	新股锁定	96.24	87.82	94	9,046.96	8,255.08	-	
301220	亚香股份	2022年06月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-	



301222	浙江恒威	2022年03月02日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	309	10,499.82	8,948.64	-
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	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通动力	2022年03月08日	6个月	新股锁定	48.51	31.38	323	15,669.20	10,135.74	-
301237	和顺科技	2022年03月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	166	9,410.54	6,948.76	-
301238	瑞泰新材	2022年06月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	794	15,228.92	25,463.58	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	3,361	113,097.65	113,097.65	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	374	12,585.10	12,585.10	-
301248	杰创智能	2022年04月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	348	13,596.36	10,394.76	-
301256	华融化学	2022年03月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,270	10,223.50	12,801.60	-
301258	富莱	2022年03月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	170	8,211.00	7,085.60	-
301259	艾布鲁	2022年04月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	436	8,689.48	13,681.68	-

301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	348	9,918.00	12,134.76	-
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	738	12,479.58	14,605.02	-
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	-
301298	东利机械	2022年05月27日	6个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年06月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	259	13,475.77	14,612.78	-
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688237	超卓航科	2022年06月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688349	三一重能	2022年06月15日	6个月	新股锁定	29.80	36.94	5,354	159,549.20	197,776.76	-
688400	凌云光	2022年06月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,651	123,926.43	123,926.43	-

注：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。

本基金持有的流通受限股票“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 10 股转增 3 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“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 10 股转增 5 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

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 10 股转增 8 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“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 10 股转增 5 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2021 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日						
资产						
银行存款	71,554,709.42	-	-	-	-	71,554,709.42
结算备付金	348,790.63	-	-	-	-	348,790.63
存出保证金	122,015.28	-	-	-	-	122,015.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-298,287,891.76	298,287,891.76
应收申购款	154,997.63	-	-	-	5,966,711.02	6,121,708.65
资产总计	72,180,512.96	-	-	-	-304,254,602.78	376,435,115.74
负债						
应付清算款	-	-	-	-	584,913.04	584,913.04
应付赎回款	-	-	-	-	1,942,433.73	1,942,433.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	384,637.82	384,637.82
应付托管费	-	-	-	-	64,106.30	64,106.30
其他负债	-	-	-	-	359,140.05	359,140.05
负债总计	-	-	-	-	3,335,230.94	3,335,230.94
利率敏感度缺口	72,180,512.96	-	-	-	-300,919,371.84	373,099,884.80
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	54,697,730.04	-	-	-	-	54,697,730.04
结算备付金	743,585.13	-	-	-	-	743,585.13
存出保证金	165,726.55	-	-	-	-	165,726.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-323,557,988.51	323,557,988.51
买入返售金融资产	25,900,000.00	-	-	-	-	25,900,000.00
其他资产	-	-	-	-	4,829.03	4,829.03
应收申购款	2,348.00	-	-	-	122,783.28	125,131.28
资产总计	81,509,389.72	-	-	-	-323,685,600.82	405,194,990.54
负债						
应付清算款	-	-	-	-	32,302,428.73	32,302,428.73
应付赎回款	-	-	-	-	510,841.56	510,841.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	454,304.51	454,304.51
应付托管费	-	-	-	-	75,717.44	75,717.44
其他负债	-	-	-	-	703,954.41	703,954.41
负债总计	-	-	-	-	34,047,246.65	34,047,246.65
利率敏感度缺口	81,509,389.72	-	-	-	-289,638,354.17	371,147,743.89

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	298,287,891.76	79.95	323,557,988.51	87.18
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	298,287,891.76	79.95	323,557,988.51	87.18

##### 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%	17,485,891.57	16,174,396.81
	业绩比较基准下降 5%	-17,485,891.57	-16,174,396.81

#### 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	295,573,179.02	319,487,033.93
第二层次	585,612.99	4,070,954.58
第三层次	2,129,099.75	-
合计	298,287,891.76	323,557,988.51

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	298,287,891.76	79.24
	其中：股票	298,287,891.76	79.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	71,903,500.05	19.10
8	其他各项资产	6,243,723.93	1.66
9	合计	376,435,115.74	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	1,332,303.44	0.36
C	制造业	159,837,708.78	42.84
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	13,561,681.68	3.63
G	交通运输、仓储和邮政业	29,784,000.00	7.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,936,714.42	2.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	32,618,905.20	8.74
M	科学研究和技术服务业	33,449,955.66	8.97
N	水利、环境和公共设施管理业	187,109.69	0.05

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,579,512.89	4.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	298,287,891.76	79.95

### 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	601888	中国中免	140,000	32,610,200.00	8.74
2	603288	海天味业	250,033	22,592,981.88	6.06
3	603345	安井食品	120,000	20,144,400.00	5.40
4	300347	泰格医药	170,000	19,456,500.00	5.21
5	600763	通策医疗	100,000	17,444,000.00	4.68
6	002352	顺丰控股	300,000	16,743,000.00	4.49
7	300558	贝达药业	250,000	15,200,000.00	4.07
8	600276	恒瑞医药	400,020	14,836,741.80	3.98
9	000963	华东医药	300,000	13,548,000.00	3.63
10	600009	上海机场	230,000	13,041,000.00	3.50
11	000858	五粮液	60,000	12,115,800.00	3.25
12	000333	美的集团	200,000	12,078,000.00	3.24
13	001215	千味央厨	200,000	11,258,000.00	3.02
14	688050	爱博医疗	50,000	11,210,000.00	3.00
15	300760	迈瑞医疗	35,000	10,962,000.00	2.94
16	600519	贵州茅台	5,000	10,225,000.00	2.74
17	688521	芯原股份	200,035	9,881,729.00	2.65
18	688105	诺唯赞	100,000	8,490,000.00	2.28
19	688690	纳微科技	90,022	7,274,677.82	1.95
20	300725	药石科技	70,000	6,929,300.00	1.86
21	688133	泰坦科技	30,163	5,327,992.32	1.43
22	603707	健友股份	146,900	4,142,580.00	1.11
23	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.36
24	688349	三一重能	5,354	197,776.76	0.05
25	301175	中科环保	39,596	151,256.72	0.04
26	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.04
27	301239	普瑞眼科	3,735	125,682.75	0.03
28	688400	凌云光	5,651	123,926.43	0.03
29	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03

30	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
31	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
32	301215	中汽股份	4,116	26,301.24	0.01
33	301238	瑞泰新材	794	25,463.58	0.01
34	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
35	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
36	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
37	301302	华如科技	259	14,612.78	0.00
38	301286	侨源股份	738	14,605.02	0.00
39	301263	泰恩康	436	13,681.68	0.00
40	301153	中科江南	308	13,545.84	0.00
41	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
42	301127	天源环保	1,179	13,122.27	0.00
43	301256	华融化学	1,270	12,801.60	0.00
44	301268	铭利达	348	12,134.76	0.00
45	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
46	301212	联盛化学	356	11,847.68	0.00
47	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
48	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
49	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
50	301109	军信股份	662	10,684.68	0.00
51	301207	华兰疫苗	189	10,663.38	0.00
52	301248	杰创智能	348	10,394.76	0.00
53	301200	大族数控	200	10,384.00	0.00
54	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
55	301236	软通动力	323	10,135.74	0.00
56	301097	天益医疗	209	9,996.47	0.00
57	301103	何氏眼科	307	9,830.14	0.00
58	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
59	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
60	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
61	301222	浙江恒威	309	8,948.64	0.00
62	301102	兆讯传媒	280	8,705.20	0.00
63	301216	万凯新材	280	8,355.20	0.00
64	301151	冠龙节能	389	8,347.94	0.00
65	301219	腾远钴业	94	8,255.08	0.00
66	300834	星辉环材	263	7,897.89	0.00
67	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
68	301135	瑞德智能	296	7,772.96	0.00
69	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
70	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00

71	301258	富士莱	170	7,085.60	0.00
72	301237	和顺科技	166	6,948.76	0.00
73	301110	青木股份	158	6,296.30	0.00
74	301196	唯科科技	117	4,389.84	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	600566	济川药业	20,559,192.00	5.54
2	300347	泰格医药	19,502,247.62	5.25
3	600763	通策医疗	17,630,991.90	4.75
4	600085	同仁堂	17,479,250.00	4.71
5	300558	贝达药业	13,814,069.00	3.72
6	600276	恒瑞医药	13,342,585.36	3.59
7	600009	上海机场	12,409,815.00	3.34
8	300841	康华生物	11,614,688.00	3.13
9	688105	诺唯赞	11,085,594.42	2.99
10	603288	海天味业	10,897,154.20	2.94
11	000538	云南白药	10,816,719.00	2.91
12	688050	爱博医疗	10,130,699.92	2.73
13	000858	五粮液	9,703,152.00	2.61
14	001215	千味央厨	9,621,667.00	2.59
15	002705	新宝股份	9,372,298.70	2.53
16	300725	药石科技	9,031,495.00	2.43
17	600519	贵州茅台	8,924,808.10	2.40
18	603707	健友股份	8,690,254.00	2.34
19	688185	康希诺	8,608,805.20	2.32
20	603987	康德莱	7,543,104.00	2.03

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	600566	济川药业	18,446,082.00	4.97
2	002603	以岭药业	16,588,442.87	4.47
3	600085	同仁堂	16,447,644.00	4.43
4	002027	分众传媒	15,717,705.09	4.23
5	002507	涪陵榨菜	13,780,514.98	3.71
6	603816	顾家家居	12,973,550.04	3.50

7	603866	桃李面包	12,902,950.80	3.48
8	688161	威高骨科	11,845,014.08	3.19
9	600276	恒瑞医药	11,662,535.22	3.14
10	688016	心脉医疗	10,925,979.66	2.94
11	001215	千味央厨	9,954,932.49	2.68
12	603987	康 德 莱	9,115,393.56	2.46
13	300841	康华生物	8,544,507.50	2.30
14	000538	云南白药	8,013,893.00	2.16
15	300973	立高食品	7,899,003.20	2.13
16	002508	老板电器	7,839,046.82	2.11
17	002475	立讯精密	7,749,151.20	2.09
18	600872	中炬高新	7,693,484.00	2.07
19	688085	三友医疗	7,337,462.59	1.98
20	002271	东方雨虹	7,268,258.12	1.96

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	352,112,304.37
卖出股票收入（成交）总额	342,517,680.20

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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	122,015.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,121,708.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,243,723.93

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
42,700	2,805.65	11,009,270.06	9.19%	108,791,819.64	90.81%

### 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	707,012.16	0.5902%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年09月15日）基金份额总额	3,309,251,362.03
本报告期期初基金份额总额	106,073,467.08
本报告期基金总申购份额	36,220,137.08
减：本报告期基金总赎回份额	22,492,514.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	119,801,089.70

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。

本报告期内，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	
财达证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	305,108,407.64	44.66%	218,039.53	38.25%	-
申万宏源	1	378,039,564.15	55.34%	352,067.15	61.75%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序



基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金租用的证券公司交易单元本报告期末未进行其他证券投资交易。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年01月21日

	告		
3	诺安主题精选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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	诺安主题精选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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	诺安主题精选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
15	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
16	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
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城国瑞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05月25日
18	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05月27日

	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	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
19	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
20	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
21	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
22	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

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主题精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安主题精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安主题精选混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安主题精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安主题精选混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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