

诺安中小盘精选混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 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 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	9
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	14
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	15
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	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	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	58
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中小盘精选混合型证券投资基金		
基金简称	诺安中小盘精选混合		
基金主代码	320011		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 04 月 28 日		
基金管理人	诺安基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	316,802,844.33 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D
下属分级基金的交易代码	320011	020648	020649
报告期末下属分级基金的份额总额	310,189,237.20 份	1,832,957.90 份	4,780,649.23 份

注：①自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安中小盘精选股票型证券投资基金”变更为“诺安中小盘精选混合型证券投资基金”；

②自 2024 年 2 月 23 日起，本基金增加 C 类及 D 类基金份额，分设 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为五部分：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略以及权证投资策略。</p> <p>1、资产配置策略 本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法，根据市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择达到在承受一定风险的前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>2、股票投资策略 本基金的股票投资策略分三步进行，首先是确定基本股票池，其次是进行个股基本面鉴别，最后是股票组合最终确认。</p> <p>3、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券投资策略 本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预</p>

	测策略(Interest rate anticipation)、收益率曲线预测策略、溢价分析策略(Yield spread analysis)以及个券估值策略(Valuation analysis)等。 5、权证投资策略 本基金的权证投资部分主要运用的投资策略包括:价值发现策略和价差策略。作为辅助性投资工具,本基金结合自身资产状况审慎投资于权证资产,力图获得最佳风险调整收益。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.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	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
---------------	------------------------------

	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D
本期已实现收益	-809,145.28	161,901.24	572,766.18
本期利润	20,483,403.98	-29,611.97	260,801.16
加权平均基金份额本期利润	0.0609	-0.0206	0.0579
本期加权平均净值利润率	2.19%	-0.72%	2.02%
本期基金份额净值增长率	2.05%	0.87%	1.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024 年 06 月 30 日)		
	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D
期末可供分配利润	554,692,255.99	3,271,882.70	8,555,231.81
期末可供分配基金份额利润	1.7882	1.7850	1.7896
期末基金资产净值	864,881,493.19	5,104,840.60	13,335,881.04
期末基金份额净值	2.788	2.785	2.790
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024 年 06 月 30 日)		
	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D
基金份额累计净值增长率	340.32%	0.87%	1.49%

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 2024 年 02 月 23 日起，本基金分设三级基金份额：A 类基金份额、C 类基金份额和 D 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

诺安中小盘精选混合 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	-2.24%	0.55%	-3.80%	0.67%	1.56%	-0.12%
过去三个月	-2.14%	0.69%	-3.35%	0.82%	1.21%	-0.13%
过去六个月	2.05%	0.96%	-3.71%	1.06%	5.76%	-0.10%
过去一年	-9.42%	0.86%	-11.57%	0.88%	2.15%	-0.02%
过去三年	-7.71%	0.96%	-21.63%	0.90%	13.92%	0.06%
自基金合同生效起至今	340.32%	1.23%	26.53%	1.19%	313.79%	0.04%

诺安中小盘精选混合 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	------	------	------	--------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-2.25%	0.54%	-3.80%	0.67%	1.55%	-0.13%
过去三个月	-2.25%	0.69%	-3.35%	0.82%	1.10%	-0.13%
自基金合同生效起至今	0.87%	0.79%	-1.75%	0.86%	2.62%	-0.07%

诺安中小盘精选混合 D

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	-2.21%	0.54%	-3.80%	0.67%	1.59%	-0.13%
过去三个月	-2.11%	0.70%	-3.35%	0.82%	1.24%	-0.12%
自基金合同生效起至今	1.49%	0.80%	-1.55%	0.87%	3.04%	-0.07%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

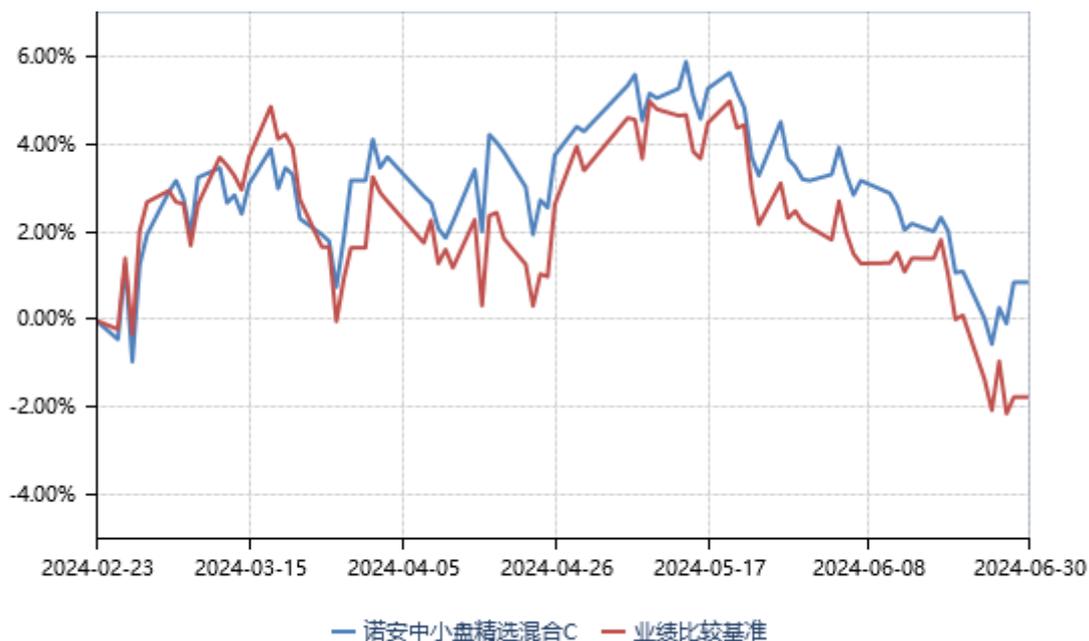
2、自 2024 年 02 月 23 日起，本基金分设三级基金份额：A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额；其中 C 类份额自 2024 年 02 月 23 日开始有申购数据，C 类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2024 年 02 月 26 日）算起；D 类份额自 2024 年 02 月 26 日开始有申购数据，D 类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2024 年 02 月 27 日）算起。

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

诺安中小盘精选混合 A



诺安中小盘精选混合 C



诺安中小盘精选混合 D



§ 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、

诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩冬燕	本基金基金经理	2016 年 09 月 13 日	-	20 年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于华夏基金管理有限公司，先后从

					<p>事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司,从事行业研究工作,现任公司总经理助理、权益投资事业部总经理。2019年4月至2023年9月任诺安恒鑫混合型证券投资基金基金经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理,2023年2月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期指根据公司决定确定的聘任日期；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备

选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中国宏观经济走在从高速增长转向长期高质量发展的路上，正处于新旧动能转换的关键期，经济新动能持续涌现，但规模尚无法完全弥补原有经济引擎特别是房地产的下行压力，随着经济增长放缓、地方债务压力加大以及地缘政治挑战可能持续，需求侧改善弹性不高是一致预期，信心有所弱化。2024 年一季度期间 A 股市场甚至还出现了一定的流动性循环连锁负反馈，市场出现了较大幅度的向下调整。随着宏观政策逆周期调节力度逐渐加大，多角度的积极变化推升市场风险偏好，A 股资金面结构问题缓和，市场从过度悲观的预期中走出。2024 年 5 月份，地产相关政策体现出大的改变，下调房贷利率、调降首付比例和政府收储均有望提振地产销售，尤其是刚性需求，虽然在房价和收入预期较弱的宏观大环境下，地产政策短期效果仍待观察，但是 5 月份起出台的地产政策长期来看将大幅降低经济和市场的系统性风险。相应地，5 月份在中国资本市场特别是港股市场出现了基于政策转向和预期修复的全球资金再平衡导致的市场上涨行情，随着全球资金再平衡效应的动

态收敛，市场在 6 月份再次步入震荡调整状态。

经济和股票市场都有周期，在投资策略上，我们对变化要抱有开放的心态，在全面审慎的投资框架下，将看长看大和动态做实相结合，在震荡的市场中尽量通过选择结构性机会为持有人实现更好的长期年化回报。在基金操作策略上，本基金致力于通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小市值股票的投资，在争取有效控制组合风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。2024 年上半年，在权衡长期和短期后，结构上，我们坚持优质蓝筹和科技成长兼顾的均衡配置；除科技方向外，我们也重点关注能反映经济复苏和结构优化的消费和先进制造业方向，包括消费制造中的医药、汽车、轻工和家电部分个股等。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安中小盘精选混合 A 份额净值为 2.788 元，本报告期诺安中小盘精选混合 A 份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.71%；截至本报告期末诺安中小盘精选混合 C 份额净值为 2.785 元，本报告期诺安中小盘精选混合 C 份额净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准收益率为-1.75%；截至本报告期末诺安中小盘精选混合 D 份额净值为 2.790 元，本报告期诺安中小盘精选混合 D 份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济与资本市场是一个复杂微妙的系统，包含国内外政府、央行、企业和居民在内的每一个微观主体都在持续向系统输入变量并且相互影响，经济增长态势、政策、改革方向、地缘政治演变和预期修正等多因素会互为因果、复杂演绎，只要政府和政策是客观务实的、企业和居民是积极努力的，即使过程中不可避免地出现周期性和曲折性，长期来看会呈现螺旋形上升的发展态势。

展望未来，证券市场能否转向由政策、基本面和风险偏好逐步改善推动的震荡上行趋势，四个驱动因素的验证至关重要，我们将动态跟踪观察：一是地产政策转向的效果及后续进一步的政策应对有待验证，二是旨在优化供给端的产业政策需要时间逐步起效，三是三中全会各项改革方针的推出值得期待，四是复杂的地缘环境对市场风险偏好的影响需要消化。

目前的市场阶段在估值上已经较大程度体现了现实的困难和信心的弱化，基于长期，我们更倾向于，在这里，看见希望，我们会致力于寻找通过降本增效、产品创新、市场拓展、适应消费趋势

变化、适应科技产业趋势变化等关键因素推动的结构性投资机会，在“投给未来，权衡成长和估值基础上的行业比较；微观和定量验证”策略框架下努力实现行业配置的优化，在个股选择上努力实现“逆取、证加、顺守、溢卖”的有效转化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，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六次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	188,121,569.09	134,909,415.18
结算备付金		879,689.02	780,990.58
存出保证金		121,312.84	167,806.44
交易性金融资产	6.4.7.2	696,141,719.38	871,221,289.58
其中：股票投资		696,141,719.38	871,221,289.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		3,049,904.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		67,292.75	139,905.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		888,381,488.06	1,007,219,406.92
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	9.22
应付赎回款		3,488,987.89	5,134,682.21
应付管理人报酬		882,671.30	1,054,186.36
应付托管费		147,111.87	175,697.76
应付销售服务费		1,800.76	-
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	538,701.41	384,597.57
负债合计		5,059,273.23	6,749,173.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	316,802,844.33	366,177,794.92
未分配利润	6.4.7.8	566,519,370.50	634,292,438.88
净资产合计		883,322,214.83	1,000,470,233.80
负债和净资产总计		888,381,488.06	1,007,219,406.92

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，诺安中小盘精选混合 A 基金份额净值 2.788 元，基金份额总额 310,189,237.20 份；诺安中小盘精选混合 C 基金份额净值 2.785 元，基金份额总额 1,832,957.90 份；诺安中小盘精选混合 D 基金份额净值 2.790 元，基金份额总额 4,780,649.23 份。诺安中小盘精选混合份额总额合计为 316,802,844.33 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		27,419,945.36	71,397,416.97
1. 利息收入		271,951.26	137,870.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	271,951.26	137,870.15
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		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,981,738.75	39,041,121.43
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,309,380.06	30,987,533.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	10,291,118.81	8,053,588.15
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	20,789,071.03	32,099,511.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	377,184.32	118,913.66
减：二、营业总支出		6,705,352.19	4,580,035.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,661,556.36	3,847,790.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	943,592.70	641,298.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,978.20	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	94,224.93	90,946.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,714,593.17	66,817,381.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,714,593.17	66,817,381.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,714,593.17	66,817,381.48

6.3 净资产变动表

会计主体：诺安中小盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	366,177,794.92	634,292,438.88	1,000,470,233.80
二、本期期初净资产	366,177,794.92	634,292,438.88	1,000,470,233.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,374,950.59	-67,773,068.38	-117,148,018.97
（一）、综合收益总额	-	20,714,593.17	20,714,593.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号	-49,374,950.59	-88,487,661.55	-137,862,612.14

金合同于 2010 年 4 月 28 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,428,556,041.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,086.09 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于 2024 年 02 月 23 日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合证券投资基金增加基金份额并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》以及更新的《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2024 年 02 月 23 日起，增加本基金的基金份额类别，分级后本基金设三类基金份额：A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额。A 类基金份额的基金代码为 320011（与分级前基金代码相同），新设 C 类基金份额代码为 020648，新设 D 类基金份额代码为 020649。其中 A 类基金份额和 D 类基金份额在申购时收取申购费用，但不从该类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在申购时不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安中小盘精选混合型证券投资基金合同》和《诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）、央行票据、资产支持证券、权证以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，股票、存托凭证等权益类金融工具投资比例占基金资产净值的 60%-95%（其中权证投资比例不超过基金资产净值的 3%）；债券等固定收益类金融工具投资比例占基金资产净值的 5%-40%（其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款）；本基金将不低于 80%的股票、存托凭证资产投资于国内股票市场上具有良好成长性和基本面的中小盘股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披

露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方

教育附加的征收规定等其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。自 2008 年 10 月 9 日起，暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	188,121,569.09

等于：本金	188,105,746.32
加：应计利息	15,822.77
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	188,121,569.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	753,020,275.15	-	696,141,719.38	-56,878,555.77
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	753,020,275.15	-	696,141,719.38	-56,878,555.77

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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,087.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	440,106.10
其中：交易所市场	440,106.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	538,701.41

6.4.7.7 实收基金

诺安中小盘精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	366,177,794.92	366,177,794.92
本期申购	16,326,835.37	16,326,835.37
本期赎回（以“-”号填列）	-72,315,393.09	-72,315,393.09
本期末	310,189,237.20	310,189,237.20

诺安中小盘精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	3,888,226.58	3,888,226.58
本期赎回（以“-”号填列）	-2,055,268.68	-2,055,268.68
本期末	1,832,957.90	1,832,957.90

诺安中小盘精选混合 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	12,966,147.65	12,966,147.65
本期赎回（以“-”号填列）	-8,185,498.42	-8,185,498.42
本期末	4,780,649.23	4,780,649.23

6.4.7.8 未分配利润

诺安中小盘精选混合 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	688,210,551.99	-53,918,113.11	634,292,438.88
本期期初	688,210,551.99	-53,918,113.11	634,292,438.88
本期利润	-809,145.28	21,292,549.26	20,483,403.98
本期基金份额交易产生的变动数	-103,918,438.14	3,834,851.27	-100,083,586.87
其中：基金申购款	30,441,828.28	-1,635,796.69	28,806,031.59
基金赎回款	-134,360,266.42	5,470,647.96	-128,889,618.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	583,482,968.57	-28,790,712.58	554,692,255.99

诺安中小盘精选混合 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	161,901.24	-191,513.21	-29,611.97
本期基金份额交易产生的变动数	3,280,387.04	21,107.63	3,301,494.67
其中：基金申购款	7,117,115.81	55,734.93	7,172,850.74
基金赎回款	-3,836,728.77	-34,627.30	-3,871,356.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,442,288.28	-170,405.58	3,271,882.70

诺安中小盘精选混合 D

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	572,766.18	-311,965.02	260,801.16
本期基金份额交易产生的变动数	8,430,187.20	-135,756.55	8,294,430.65
其中：基金申购款	23,737,261.97	80,395.17	23,817,657.14
基金赎回款	-15,307,074.77	-216,151.72	-15,523,226.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,002,953.38	-447,721.57	8,555,231.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	267,777.07
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	3,258.48
其他	915.71
合计	271,951.26

注：此处“其他”列示的是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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	637,524,799.78
减：卖出股票成本总额	640,741,643.07
减：交易费用	1,092,536.77
买卖股票差价收入	-4,309,380.06

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,291,118.81
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	10,291,118.81

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,789,071.03
--股票投资	20,789,071.03
--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	20,789,071.03

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	369,566.17
其他	7,618.15
合计	377,184.32

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	55.33
汇划手续费	162.00
账户维护费	4,500.00
合计	94,224.93

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,661,556.36	3,847,790.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,882,621.52	1,343,157.14
应支付基金管理人的净管理费	3,778,934.84	2,504,633.08

注：本基金的管理费率为年费率 1.20%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2023 年 08 月 28 日前，本基金管理费率为 1.50%。本基金管理人自 2023 年 08 月 28 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为 1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	943,592.70	641,298.41

注：本基金的托管费率为年费率 0.20%。

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：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

2023 年 08 月 28 日前，本基金托管费率为 0.25%。本基金管理人自 2023 年 08 月 28 日起对本基金实施调整后的基金托管费率，调整后的基金托管费率为 0.20%。

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			
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D	合计
诺安基金管理有限公司	-	-	-	-
中国工商银行股份有限公司	-	4,898.10	-	4,898.10
合计	-	4,898.10	-	4,898.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D	合计

诺安基金管理有限公司	-	-	-	-
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金诺安中小盘精选混合 A 类基金份额和 D 类基金份额不收取销售服务费，诺安中小盘精选混合 C 类基金份额的年销售服务费年费率为 0.40%。

诺安中小盘精选混合 C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为诺安中小盘精选混合 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为诺安中小盘精选混合 C 类基金份额前一日基金资产净值

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	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

名称	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		2023 年 01 月 01 日至 2023 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-活期存款	188,121,569.09	267,777.07	86,687,835.70	130,638.52

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2024 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
001359	平安电工	2024年03月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年01月04日	6个月	新股锁定	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年03月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
30139	汇成	2024年	6个月	新股锁	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

2	真空	05月28日		定							
301502	华阳智能	2024年01月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-	
301536	星宸科技	2024年03月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-	
301538	骏鼎达	2024年03月13日	6个月	新股锁定	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-	
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024年06月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024年06月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024年03月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年03月06日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-	
301591	肯特股份	2024年02月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股份	2024年01月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-	
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	
603285	键邦股份	2024年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-	

		日								
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年01月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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“001387 雪祺电气”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；本基金持有的流通受限股票“301538 骏鼎达”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股；本基金持有的流通受限股票“301589 诺瓦星云”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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

的立体式风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无债券投资（2023 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 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部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（净资产）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 2024 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 2024 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每

个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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						
货币资金	188,121,569.09	-	-	-	-	188,121,569.09
结算备付金	879,689.02	-	-	-	-	879,689.02
存出保证金	121,312.84	-	-	-	-	121,312.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-696,141,719.38	696,141,719.38
应收清算款	-	-	-	-	3,049,904.98	3,049,904.98
应收申购款	-	-	-	-	67,292.75	67,292.75
资产总计	189,122,570.95	-	-	-	-699,258,917.11	888,381,488.06
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,488,987.89	3,488,987.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	882,671.30	882,671.30
应付托管费	-	-	-	-	147,111.87	147,111.87
应付销售服务费	-	-	-	-	1,800.76	1,800.76
其他负债	-	-	-	-	538,701.41	538,701.41
负债总计	-	-	-	-	5,059,273.23	5,059,273.23
利率敏感度缺口	189,122,570.95	-	-	-	-694,199,643.88	883,322,214.83
上年度末 2023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						
货币资金	134,909,415.18	-	-	-	-	134,909,415.18
结算备付金	780,990.58	-	-	-	-	780,990.58
存出保证金	167,806.44	-	-	-	-	167,806.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-871,221,289.58	871,221,289.58
应收申购款	-	-	-	-	139,905.14	139,905.14
资产总计	135,858,212.20	-	-	-	-871,361,194.72	1,007,219,406.92
负债						
应付清算款	-	-	-	-	9.22	9.22
应付赎回款	-	-	-	-	5,134,682.21	5,134,682.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,054,186.36	1,054,186.36
应付托管费	-	-	-	-	175,697.76	175,697.76

其他负债	-	-	-	384,597.57	384,597.57
负债总计	-	-	-	6,749,173.12	6,749,173.12
利率敏感度缺口	135,858,212.20	-	-	-864,612,021.60	1,000,470,233.80

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 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(2023 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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	696,141,719.38	78.81	871,221,289.58	87.08
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	696,141,719.38	78.81	871,221,289.58	87.08

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(2024年06月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	25,087,694.07	45,886,978.68
	业绩比较基准下降 5%	-25,087,694.07	-45,886,978.68

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	695,608,332.22	870,050,094.42
第二层次	45,611.11	-
第三层次	487,776.05	1,171,195.16
合计	696,141,719.38	871,221,289.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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	696,141,719.38	78.36
	其中：股票	696,141,719.38	78.36
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	189,001,258.11	21.27
8	其他各项资产	3,238,510.57	0.36
9	合计	888,381,488.06	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	9,085.90	0.00
B	采矿业	17,238,474.15	1.95
C	制造业	360,804,762.65	40.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	122,113.88	0.01
E	建筑业	89,365.06	0.01

F	批发和零售业	78,311,910.89	8.87
G	交通运输、仓储和邮政业	62,690,728.97	7.10
H	住宿和餐饮业	5,896.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,504,299.60	18.96
J	金融业	49,400.58	0.01
K	房地产业	16,420.75	0.00
L	租赁和商务服务业	8,357,852.99	0.95
M	科学研究和技术服务业	337,375.78	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	407,205.02	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	87,715.41	0.01
R	文化、体育和娱乐业	109,110.95	0.01
S	综合	-	-
	合计	696,141,719.38	78.81

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	600050	中国联通	16,626,047	78,142,420.90	8.85
2	601728	中国电信	12,660,090	77,859,553.50	8.81
3	601607	上海医药	2,260,031	43,189,192.41	4.89
4	000538	云南白药	502,640	25,710,036.00	2.91
5	002236	大华股份	1,660,089	25,664,975.94	2.91
6	688347	华虹公司	688,089	24,667,990.65	2.79
7	601018	宁波港	7,087,800	24,098,520.00	2.73
8	600166	福田汽车	10,260,000	23,085,000.00	2.61
9	600018	上港集团	3,600,000	20,808,000.00	2.36
10	600332	白云山	700,000	20,531,000.00	2.32
11	603501	韦尔股份	206,000	20,470,220.00	2.32
12	600916	中国黄金	2,060,000	19,817,200.00	2.24
13	603986	兆易创新	206,000	19,697,720.00	2.23
14	603816	顾家家居	600,000	19,374,000.00	2.19
15	002371	北方华创	60,000	19,193,400.00	2.17
16	600398	海澜之家	2,060,000	19,034,400.00	2.15
17	600600	青岛啤酒	260,000	18,920,200.00	2.14

18	603899	晨光股份	600,015	18,768,469.20	2.12
19	603008	喜临门	1,080,000	18,716,400.00	2.12
20	688981	中芯国际	390,000	17,979,000.00	2.04
21	601816	京沪高铁	3,300,000	17,721,000.00	2.01
22	601857	中国石油	1,660,000	17,131,200.00	1.94
23	000034	神州数码	660,000	15,107,400.00	1.71
24	600285	羚锐制药	600,000	14,526,000.00	1.64
25	600750	江中药业	626,075	14,468,593.25	1.64
26	600085	同仁堂	360,000	13,755,600.00	1.56
27	603365	水星家纺	660,000	10,329,000.00	1.17
28	688213	思特威	206,000	9,991,000.00	1.13
29	300662	科锐国际	516,638	8,333,370.94	0.94
30	600765	中航重机	360,000	7,344,000.00	0.83
31	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
32	688351	微电生理	6,613	145,750.52	0.02
33	301281	科源制药	3,314	74,399.30	0.01
34	301326	捷邦科技	2,264	73,670.56	0.01
35	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.01
36	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.01
37	301328	维峰电子	1,979	73,044.89	0.01
38	301282	金禄电子	3,066	72,909.48	0.01
39	688209	英集芯	5,867	72,809.47	0.01
40	688581	安杰思	1,487	72,758.91	0.01
41	301220	亚香股份	2,849	72,706.48	0.01
42	301223	中荣股份	4,939	72,652.69	0.01
43	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.01
44	301388	欣灵电气	2,920	72,153.20	0.01
45	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.01
46	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.01
47	301135	瑞德智能	3,376	71,875.04	0.01
48	688719	爱科赛博	2,715	70,780.05	0.01
49	688273	麦澜德	3,517	69,636.60	0.01
50	688292	浩瀚深度	4,503	69,616.38	0.01
51	301305	朗坤环境	4,570	69,509.70	0.01
52	688689	银河微电	3,258	69,167.34	0.01
53	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.01
54	688291	金橙子	3,961	68,208.42	0.01
55	688435	英方软件	2,728	68,090.88	0.01
56	301345	涛涛车业	1,226	67,552.60	0.01
57	688132	邦彦技术	3,875	67,231.25	0.01
58	301171	易点天下	4,561	67,046.70	0.01

59	688252	天德钰	4,606	66,925.18	0.01
60	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.01
61	301272	英华特	1,729	66,704.82	0.01
62	688458	美芯晟	2,479	66,437.20	0.01
63	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.01
64	300834	星辉环材	3,301	66,020.00	0.01
65	688195	腾景科技	2,693	66,005.43	0.01
66	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.01
67	301182	凯旺科技	2,932	65,031.76	0.01
68	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.01
69	301267	华夏眼科	3,108	64,397.76	0.01
70	688480	赛恩斯	2,302	64,133.72	0.01
71	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.01
72	301203	国泰环保	2,243	63,499.33	0.01
73	301125	腾亚精工	6,409	63,385.01	0.01
74	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.01
75	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.01
76	688251	井松智能	3,392	62,989.44	0.01
77	301232	飞沃科技	2,300	62,606.00	0.01
78	688259	创耀科技	1,542	61,618.32	0.01
79	301335	天元宠物	3,835	60,938.15	0.01
80	688507	索辰科技	1,251	60,798.60	0.01
81	688503	聚和材料	2,153	60,499.30	0.01
82	688114	华大智造	1,272	60,305.52	0.01
83	688433	华曙高科	2,890	60,285.40	0.01
84	301152	天力锂能	2,499	60,200.91	0.01
85	688512	慧智微	7,064	59,973.36	0.01
86	301233	盛帮股份	1,576	59,919.52	0.01
87	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.01
88	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.01
89	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.01
90	301382	蜂助手	3,259	58,955.31	0.01
91	301439	泓淋电力	4,648	58,890.16	0.01
92	688247	宣泰医药	7,155	58,814.10	0.01
93	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.01
94	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.01
95	688237	超卓航科	2,891	57,964.55	0.01
96	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.01
97	603275	众辰科技	1,929	57,870.00	0.01
98	688416	恒烁股份	1,519	57,676.43	0.01
99	688236	春立医疗	4,052	57,457.36	0.01

100	688084	晶品特装	1,312	57,334.40	0.01
101	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.01
102	301163	宏德股份	2,764	56,164.48	0.01
103	301290	东星医疗	2,808	55,907.28	0.01
104	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.01
105	301283	聚胶股份	1,924	54,583.88	0.01
106	688657	浩辰软件	1,472	54,405.12	0.01
107	301246	宏源药业	4,031	54,257.26	0.01
108	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.01
109	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.01
110	301161	唯万密封	3,460	53,733.80	0.01
111	301227	森鹰窗业	2,840	53,420.40	0.01
112	301276	嘉曼服饰	2,534	53,112.64	0.01
113	688105	诺唯赞	2,635	52,726.35	0.01
114	301316	慧博云通	3,584	52,613.12	0.01
115	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.01
116	688479	友车科技	3,263	51,849.07	0.01
117	301231	荣信文化	2,744	51,806.72	0.01
118	301265	华新环保	6,545	51,770.95	0.01
119	688231	隆达股份	3,613	51,521.38	0.01
120	688152	麒麟信安	1,329	51,458.88	0.01
121	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.01
122	301270	汉仪股份	2,095	50,552.35	0.01
123	688227	品高股份	4,164	50,426.04	0.01
124	301288	清研环境	4,516	50,398.56	0.01
125	301313	凡拓数创	2,464	50,142.40	0.01
126	301319	唯特偶	1,666	50,029.98	0.01
127	301197	工大科雅	3,791	49,737.92	0.01
128	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
129	300804	广康生化	2,257	49,202.60	0.01
130	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.01
131	688115	思林杰	2,024	47,725.92	0.01
132	301296	新巨丰	6,593	47,535.53	0.01
133	603135	中重科技	3,785	47,426.05	0.01
134	688489	三未信安	1,761	46,913.04	0.01
135	301309	万得凯	1,834	46,877.04	0.01
136	301158	德石股份	3,783	46,795.71	0.01
137	001380	华纬科技	2,406	46,772.64	0.01
138	688671	碧兴物联	2,253	46,704.69	0.01
139	688255	凯尔达	2,309	46,295.45	0.01
140	301300	远翔新材	2,107	46,164.37	0.01

141	688381	帝奥微	2,363	46,031.24	0.01
142	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.01
143	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.01
144	688737	中自科技	2,720	44,064.00	0.00
145	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
146	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.00
147	688203	海正生材	5,109	43,426.50	0.00
148	301196	唯科科技	1,460	43,113.80	0.00
149	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
150	688171	纬德信息	2,821	42,540.68	0.00
151	688353	华盛锂电	2,448	42,497.28	0.00
152	301166	优宁维	1,558	42,066.00	0.00
153	301322	绿通科技	2,167	40,674.59	0.00
154	688420	美腾科技	1,960	40,532.80	0.00
155	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
156	688450	光格科技	1,662	40,453.08	0.00
157	688391	钜泉科技	1,370	39,962.90	0.00
158	688184	帕瓦股份	3,138	38,189.46	0.00
159	688455	科捷智能	4,749	38,134.47	0.00
160	688265	南模生物	1,820	37,928.80	0.00
161	688173	希荻微	3,409	37,601.27	0.00
162	688448	磁谷科技	1,985	37,476.80	0.00
163	300979	华利集团	615	37,422.75	0.00
164	601133	柏诚股份	3,478	37,179.82	0.00
165	688249	晶合集成	2,518	36,939.06	0.00
166	001328	登康口腔	1,423	36,001.90	0.00
167	301327	华宝新能	628	35,984.40	0.00
168	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
169	301153	中科江南	1,240	35,042.40	0.00
170	301228	实朴检测	3,721	34,791.35	0.00
171	688370	丛麟科技	2,167	34,585.32	0.00
172	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.00
173	601065	江盐集团	3,878	33,622.26	0.00
174	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
175	688548	广钢气体	3,603	32,895.39	0.00
176	688511	天微电子	1,490	32,437.30	0.00
177	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
178	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
179	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
180	301291	明阳电气	1,007	30,260.35	0.00
181	301498	乖宝宠物	554	29,805.20	0.00

182	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
183	688563	航材股份	549	29,031.12	0.00
184	688549	中巨芯	4,294	28,984.50	0.00
185	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
186	603125	常青科技	1,650	28,396.50	0.00
187	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
188	688485	九州一轨	3,580	27,924.00	0.00
189	301215	中汽股份	4,743	27,793.98	0.00
190	603231	索宝蛋白	1,610	27,434.40	0.00
191	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.00
192	688509	正元地信	9,362	27,056.18	0.00
193	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
194	301035	润丰股份	600	26,724.00	0.00
195	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.00
196	301349	信德新材	932	25,760.48	0.00
197	603296	华勤技术	465	25,681.95	0.00
198	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.00
199	601089	福元医药	1,749	24,223.65	0.00
200	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
201	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
202	300919	中伟股份	742	22,994.58	0.00
203	001339	智微智能	812	22,419.32	0.00
204	688702	盛科通信	549	22,234.50	0.00
205	001258	立新能源	3,188	22,092.84	0.00
206	001360	南矿集团	1,762	21,654.98	0.00
207	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
208	001269	欧晶科技	764	21,239.20	0.00
209	688361	中科飞测	449	21,237.70	0.00
210	600927	永安期货	1,859	20,727.85	0.00
211	001311	多利科技	844	20,407.92	0.00
212	301486	致尚科技	482	20,393.42	0.00
213	603071	物产环能	1,627	20,386.31	0.00
214	688038	中科通达	2,132	20,296.64	0.00
215	301236	软通动力	576	20,280.96	0.00
216	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
217	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
218	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
219	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
220	001314	亿道信息	508	19,522.44	0.00
221	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.00
222	301175	中科环保	4,422	19,412.58	0.00

223	301050	雷电微力	401	19,312.16	0.00
224	001330	博纳影业	3,564	19,281.24	0.00
225	301559	中集环科	1,315	19,159.55	0.00
226	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
227	300926	博俊科技	936	18,738.72	0.00
228	001227	兰州银行	7,868	18,725.84	0.00
229	301348	蓝箭电子	613	18,629.07	0.00
230	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.00
231	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.00
232	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
233	688582	芯动联科	648	18,247.68	0.00
234	001298	好上好	847	18,032.63	0.00
235	301039	中集车辆	2,064	17,750.40	0.00
236	603211	晋拓股份	1,287	17,644.77	0.00
237	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.00
238	605598	上海港湾	774	17,097.66	0.00
239	603191	望变电气	1,149	17,005.20	0.00
240	300917	特发服务	475	16,420.75	0.00
241	688652	京仪装备	416	16,261.44	0.00
242	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.00
243	301120	新特电气	1,548	16,083.72	0.00
244	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
245	301099	雅创电子	351	15,672.15	0.00
246	301238	瑞泰新材	1,043	15,613.71	0.00
247	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
248	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
249	603097	江苏华辰	577	15,302.04	0.00
250	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.00
251	301239	普瑞眼科	431	15,227.23	0.00
252	301018	申菱环境	782	15,202.08	0.00
253	301371	敷尔佳	485	15,064.10	0.00
254	301525	儒竞科技	266	14,970.48	0.00
255	001288	运机集团	537	14,864.16	0.00
256	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
257	301421	波长光电	332	14,352.36	0.00
258	301155	海力风电	346	13,919.58	0.00
259	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
260	603235	天新药业	572	13,745.16	0.00
261	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
262	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
263	301370	国科恒泰	1,240	13,478.80	0.00

264	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
265	688591	泰凌微	681	13,313.55	0.00
266	603230	内蒙新华	1,141	13,167.14	0.00
267	301029	怡合达	665	13,073.90	0.00
268	301381	赛维时代	571	12,978.83	0.00
269	301172	君逸数码	438	12,868.44	0.00
270	301259	艾布鲁	628	12,779.80	0.00
271	605011	杭州热电	525	12,773.25	0.00
272	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
273	301263	泰恩康	1,017	12,743.01	0.00
274	301488	豪恩汽电	262	12,602.20	0.00
275	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
276	301550	斯菱股份	260	12,456.60	0.00
277	300868	杰美特	588	12,318.60	0.00
278	605339	南侨食品	864	12,286.08	0.00
279	301558	三态股份	1,458	12,232.62	0.00
280	301095	广立微	296	12,171.52	0.00
281	688275	万润新能	401	11,797.42	0.00
282	001318	阳光乳业	1,142	11,751.18	0.00
283	300860	锋尚文化	556	11,698.24	0.00
284	300908	仲景食品	416	11,556.48	0.00
285	603209	兴通股份	833	11,528.72	0.00
286	603255	鼎际得	489	11,393.70	0.00
287	300873	海晨股份	774	11,284.92	0.00
288	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
289	603237	五芳斋	455	11,220.30	0.00
290	301149	隆华新材	1,214	11,217.36	0.00
291	301179	泽宇智能	570	11,092.20	0.00
292	301251	威尔高	321	11,052.03	0.00
293	301510	固高科技	396	10,989.00	0.00
294	301015	百洋医药	462	10,870.86	0.00
295	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.00
296	300968	格林精密	1,162	10,760.12	0.00
297	301507	民生健康	851	10,739.62	0.00
298	605086	龙高股份	620	10,701.20	0.00
299	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
300	300814	中富电路	328	10,591.12	0.00
301	300864	南大环境	537	10,525.20	0.00
302	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
303	300878	维康药业	722	10,497.88	0.00
304	688627	精智达	222	10,305.24	0.00

305	301090	华润材料	1,560	10,264.80	0.00
306	301180	万祥科技	654	10,228.56	0.00
307	300918	南山智尚	1,063	10,141.02	0.00
308	001229	魅视科技	347	10,121.99	0.00
309	301517	陕西华达	185	9,990.00	0.00
310	001236	弘业期货	1,399	9,946.89	0.00
311	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
312	301199	迈赫股份	402	9,720.36	0.00
313	301256	华融化学	1,555	9,547.70	0.00
314	300956	英力股份	445	9,518.55	0.00
315	301137	哈焊华通	644	9,383.08	0.00
316	301097	天益医疗	249	9,372.36	0.00
317	300930	屹通新材	322	9,366.98	0.00
318	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
319	001322	箭牌家居	1,260	9,210.60	0.00
320	301168	通灵股份	329	9,139.62	0.00
321	605577	龙版传媒	588	9,131.64	0.00
322	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
323	300972	万辰集团	430	9,085.90	0.00
324	301489	思泉新材	128	9,034.24	0.00
325	605028	世茂能源	615	8,874.45	0.00
326	301413	安培龙	214	8,848.90	0.00
327	001319	铭科精技	536	8,736.80	0.00
328	001300	三柏硕	763	8,675.31	0.00
329	603070	万控智造	775	8,672.25	0.00
330	603130	云中马	480	8,467.20	0.00
331	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
332	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
333	301030	仕净科技	339	8,346.18	0.00
334	301185	鸥玛软件	578	8,282.74	0.00
335	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
336	300881	盛德鑫泰	320	8,220.80	0.00
337	301222	浙江恒威	332	8,220.32	0.00
338	605580	恒盛能源	916	8,161.56	0.00
339	001212	中旗新材	400	8,120.00	0.00
340	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
341	301103	何氏眼科	377	8,090.42	0.00
342	301298	东利机械	634	8,083.50	0.00
343	001228	永泰运	383	8,073.64	0.00
344	605259	绿田机械	413	8,057.63	0.00
345	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00

346	301110	青木科技	272	8,032.16	0.00
347	605488	福莱新材	603	7,839.00	0.00
348	301568	思泰克	246	7,827.72	0.00
349	301200	大族数控	246	7,763.76	0.00
350	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
351	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
352	605180	华生科技	649	7,690.65	0.00
353	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
354	603073	彩蝶实业	530	7,663.80	0.00
355	301193	家联科技	475	7,581.00	0.00
356	301181	标榜股份	334	7,575.12	0.00
357	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
358	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
359	001331	胜通能源	539	7,465.15	0.00
360	001222	源飞宠物	608	7,448.00	0.00
361	001238	浙江正特	374	7,412.68	0.00
362	301315	威士顿	226	7,365.34	0.00
363	603215	比依股份	575	7,354.25	0.00
364	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
365	001366	播恩集团	646	7,170.60	0.00
366	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
367	301268	铭利达	458	7,121.90	0.00
368	301069	凯盛新材	539	7,066.29	0.00
369	001317	三羊马	300	7,047.00	0.00
370	001219	青岛食品	598	7,038.46	0.00
371	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
372	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00
373	001268	联合精密	409	6,924.37	0.00
374	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
375	301138	华研精机	285	6,808.65	0.00
376	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
377	001260	坤泰股份	484	6,742.12	0.00
378	603048	浙江黎明	464	6,737.28	0.00
379	301469	恒达新材	275	6,712.75	0.00
380	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
381	300975	商络电子	738	6,671.52	0.00
382	301020	密封科技	421	6,660.22	0.00
383	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
384	300985	致远新能	413	6,616.26	0.00
385	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
386	301089	拓新药业	220	6,527.40	0.00

387	001256	炜冈科技	474	6,503.28	0.00
388	300991	创益通	407	6,467.23	0.00
389	603170	宝立食品	542	6,438.96	0.00
390	301028	东亚机械	733	6,428.41	0.00
391	688693	锆威特	178	6,393.76	0.00
392	301045	天禄科技	335	6,385.10	0.00
393	301555	惠柏新材	224	6,345.92	0.00
394	301528	多浦乐	148	6,340.32	0.00
395	605300	佳禾食品	576	6,301.44	0.00
396	603150	万朗磁塑	251	6,285.04	0.00
397	301100	风光股份	483	6,274.17	0.00
398	001230	劲旅环境	450	6,250.50	0.00
399	300879	大叶股份	466	6,235.08	0.00
400	301133	金钟股份	286	6,231.94	0.00
401	001209	洪兴股份	450	6,210.00	0.00
402	603151	邦基科技	535	6,173.90	0.00
403	300877	金春股份	569	6,167.96	0.00
404	605287	德才股份	489	6,156.51	0.00
405	301372	科净源	231	6,156.15	0.00
406	301216	万凯新材	546	6,109.74	0.00
407	301207	华兰疫苗	345	6,096.15	0.00
408	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
409	688573	信宇人	285	6,093.30	0.00
410	301041	金百泽	215	6,063.00	0.00
411	300876	蒙泰高新	350	6,013.00	0.00
412	001336	楚环科技	274	5,986.90	0.00
413	301126	达嘉维康	662	5,977.86	0.00
414	001210	金房能源	448	5,944.96	0.00
415	300963	中洲特材	552	5,939.52	0.00
416	603051	鹿山新材	272	5,937.76	0.00
417	301073	君亭酒店	324	5,896.80	0.00
418	300952	恒辉安防	340	5,895.60	0.00
419	301012	扬电科技	238	5,892.88	0.00
420	301102	兆讯传媒	499	5,883.21	0.00
421	301533	威马农机	225	5,780.25	0.00
422	603182	嘉华股份	546	5,743.92	0.00
423	301046	能辉科技	290	5,704.30	0.00
424	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00
425	301130	西点药业	237	5,552.91	0.00
426	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
427	301017	漱玉平民	555	5,461.20	0.00

428	301092	争光股份	241	5,456.24	0.00
429	605189	富春染织	508	5,415.28	0.00
430	301258	富士莱	217	5,394.62	0.00
431	300889	爱克股份	479	5,374.38	0.00
432	301219	腾远钴业	140	5,356.40	0.00
433	301062	上海艾录	523	5,339.83	0.00
434	301036	双乐股份	205	5,334.10	0.00
435	301111	粤万年青	379	5,287.05	0.00
436	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
437	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
438	603119	浙江荣泰	294	5,209.68	0.00
439	001202	炬申股份	459	5,200.47	0.00
440	301116	益客食品	577	5,152.61	0.00
441	301108	洁雅股份	208	5,056.48	0.00
442	301038	深水规院	346	5,017.00	0.00
443	001231	农心科技	355	4,994.85	0.00
444	301237	和顺科技	214	4,892.04	0.00
445	605567	春雪食品	629	4,818.14	0.00
446	301060	兰卫医学	587	4,766.44	0.00
447	300945	曼卡龙	531	4,731.21	0.00
448	301118	恒光股份	315	4,696.65	0.00
449	301026	浩通科技	203	4,660.88	0.00
450	603107	上海汽配	292	4,639.88	0.00
451	301016	雷尔伟	275	4,628.25	0.00
452	300971	博亚精工	245	4,574.15	0.00
453	301011	华立科技	296	4,561.36	0.00
454	301021	英诺激光	290	4,547.20	0.00
455	301088	戎美股份	403	4,513.60	0.00
456	300998	宁波方正	201	4,419.99	0.00
457	301059	金三江	492	4,383.72	0.00
458	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
459	301033	迈普医学	108	4,223.88	0.00
460	301055	张小泉	355	4,210.30	0.00
461	300943	春晖智控	383	4,132.57	0.00
462	301025	读客文化	403	4,025.97	0.00
463	301066	万事利	482	3,904.20	0.00
464	301068	大地海洋	187	3,878.38	0.00
465	603270	金帝股份	195	3,868.80	0.00
466	301078	孩子王	756	3,825.36	0.00
467	603272	联翔股份	443	3,765.50	0.00
468	300892	品渥食品	272	3,710.08	0.00

469	300931	通用电梯	672	3,682.56	0.00
470	301072	中捷精工	181	3,598.28	0.00
471	301198	喜悦智行	443	3,548.43	0.00
472	301007	德迈仕	303	3,539.04	0.00
473	300960	通业科技	234	3,526.38	0.00
474	301049	超越科技	196	3,518.20	0.00
475	301098	金埔园林	461	3,489.77	0.00
476	301032	新柴股份	513	3,442.23	0.00
477	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
478	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
479	300958	建工修复	300	3,189.00	0.00
480	300992	泰福泵业	200	3,156.00	0.00
481	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
482	300886	华业香料	191	3,136.22	0.00
483	300961	深水海纳	394	3,073.20	0.00
484	301063	海锅股份	153	2,194.02	0.00
485	301386	未来电器	76	1,576.24	0.00
486	301285	鸿日达	43	1,121.87	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	600332	白云山	27,133,615.00	2.71
2	601018	宁波港	25,377,062.00	2.54
3	600905	三峡能源	24,062,619.00	2.41
4	688347	华虹公司	23,362,719.88	2.34
5	600362	江西铜业	23,150,251.99	2.31
6	603365	水星家纺	22,470,325.00	2.25
7	601857	中国石油	20,745,190.00	2.07
8	600018	上港集团	20,611,100.00	2.06
9	600600	青岛啤酒	19,510,651.00	1.95
10	000725	京东方 A	19,352,131.00	1.93
11	000858	五粮液	18,462,100.00	1.85
12	002371	北方华创	17,678,560.00	1.77
13	601816	京沪高铁	17,148,743.00	1.71
14	600054	黄山旅游	16,457,529.00	1.64
15	600085	同仁堂	16,045,481.00	1.60
16	300729	乐歌股份	15,551,166.00	1.55
17	603019	中科曙光	11,799,403.00	1.18

18	000538	云南白药	11,740,457.20	1.17
19	688213	思特威	11,209,071.73	1.12
20	688777	中控技术	10,397,754.57	1.04

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	601857	中国石油	57,406,758.66	5.74
2	600750	江中药业	38,124,163.40	3.81
3	600362	江西铜业	32,584,696.07	3.26
4	600166	福田汽车	32,279,479.00	3.23
5	600612	老凤祥	27,988,252.64	2.80
6	002223	鱼跃医疗	25,747,860.04	2.57
7	002867	周大生	24,944,182.00	2.49
8	600905	三峡能源	23,238,378.02	2.32
9	600699	均胜电子	23,023,905.00	2.30
10	000725	京东方 A	20,394,284.00	2.04
11	601728	中国电信	20,003,027.00	2.00
12	300662	科锐国际	18,844,032.92	1.88
13	601607	上海医药	16,968,145.00	1.70
14	002236	大华股份	16,884,592.00	1.69
15	000858	五粮液	16,270,881.00	1.63
16	603019	中科曙光	16,053,082.00	1.60
17	300729	乐歌股份	15,425,039.16	1.54
18	600054	黄山旅游	14,939,818.96	1.49
19	002036	联创电子	13,156,038.00	1.31
20	000887	中鼎股份	13,066,670.71	1.31

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	444,873,001.84
卖出股票收入(成交)总额	637,524,799.78

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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中，上海医药集团股份有限公司在报告编制日前一年内受到上海市市场监督管理局的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体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	121,312.84
2	应收清算款	3,049,904.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	67,292.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,238,510.57

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
诺安中小 盘精选混 合 A	19,412	15,979.25	40,483,268.7 1	13.05%	269,705,968.49	86.95%
诺安中小 盘精选混 合 C	289	6,342.41	302,469.03	16.50%	1,530,488.87	83.50%
诺安中小 盘精选混 合 D	69	69,284.77	-	-	4,780,649.23	100.00%
合计	19,770	16,024.42	40,785,737.7 4	12.87%	276,017,106.59	87.13%

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	诺安中小盘精选混合 A	3,100.05	0.0010%
	诺安中小盘精选混合 C	36.22	0.0020%
	诺安中小盘精选混合 D	43.21	0.0009%
	合计	3,179.48	0.0010%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	诺安中小盘精选混合 A	0
	诺安中小盘精选混合 C	0
	诺安中小盘精选混合 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安中小盘精选混合 A	0
	诺安中小盘精选混合 C	0
	诺安中小盘精选混合 D	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安中小盘精选混合 A	诺安中小盘精选混合 C	诺安中小盘精选混合 D

基金合同生效日（2010 年 04 月 28 日）基金份额总额	1,428,556,041.60	-	-
本报告期初基金份额总额	366,177,794.92	-	-
本报告期基金总申购份额	16,326,835.37	3,888,226.58	12,966,147.65
减：本报告期基金总赎回份额	72,315,393.09	2,055,268.68	8,185,498.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	310,189,237.20	1,832,957.90	4,780,649.23

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	159,313,743.52	14.75%	150,881.30	21.41%	-
国海证券	1	304,344,040.50	28.17%	284,838.27	40.43%	-
国盛证券	1	616,779,154.51	57.09%	268,862.32	38.16%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 信誉良好，财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- (2) 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，能为本基金提供全面的信息服务；
- (3) 研究实力较强，有足够数量的专职的高素质研究人员，能为公司提供全面的研究支持和信息服务；
- (4) 能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；
- (5) 公司要求的其他条件。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用的证券公司交易单元本报告期末未进行其他证券投资交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加广发银行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》	2024年01月08日
2	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 202	基金管理人网站	2024年01月22日

	3 年第 4 季度报告		
3	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 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》	2024年01月22日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月02日
5	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告	《上海证券报》	2024年02月23日
6	诺安中小盘精选混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2024年02月23日
7	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2024年02月23日
8	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2024年02月23日
9	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）2024 年第 1 期	基金管理人网站	2024年02月23日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月29日
11	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）2024 年第 2 期	基金管理人网站	2024年03月01日
12	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 C 增加销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年03月01日
13	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2024年03月01日
14	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合基金调整赎回费率的公告	《上海证券报》	2024年03月01日
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2024年03月04日
16	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 C 增加销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年03月04日
17	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）2024 年第 3 期	基金管理人网站	2024年03月07日
18	诺安中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的	《上海证券报》	2024年03月07日

	提示性公告		
19	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2024年03月07日
20	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 C 增加京东肯特瑞为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年03月22日
21	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024年03月29日
22	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 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》	2024年03月29日
23	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 C 增加格上富信为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年04月02日
24	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 D 增加工商银行作为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年04月03日
25	诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选混合 C 增加工商银行作为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2024年04月08日
26	诺安中小盘精选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2024年04月22日
27	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 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》	2024年04月22日
28	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销渠道的申购起点金额、最小追加申购金额及最低赎回份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年05月24日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加首创证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年05月29日
30	诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2024年05月31日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年05月31日
32	诺安基金管理有限公司关于终止北京懒猫基金销售有限公司办理本公司旗下基	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2024年06月07日

	金销售业务的公告	《证券日报》	
33	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销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	2024年06月14日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金元证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2024年06月14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中小盘精选股票型证券投资基金募集的文件。
- ② 《诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》。
- ③ 《诺安中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》。
- ④ 《诺安基金管理有限公司关于诺安中小盘精选股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥报告期内诺安中小盘精选混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2024 年 08 月 30 日