

# 诺安主题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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	14
6.3	净资产变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	35
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	41
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	41
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	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41

7.12	投资组合报告附注.....	41
§ 8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§ 9	开放式基金份额变动.....	43
§ 10	重大事件揭示.....	43
10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8	其他重大事件.....	44
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	45
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.....	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§ 12	备查文件目录.....	46
12.1	备查文件目录.....	46
12.2	存放地点.....	46
12.3	查阅方式.....	46

## § 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	97,336,354.46 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	王小飞
	联系电话	0755-83026688	021-60637103
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-888-8998	021-60637228	
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	张金良	

## 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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-47,797,803.48
本期利润	-16,608,491.41
加权平均基金份额本期利润	-0.1656
本期加权平均净值利润率	-7.45%
本期基金份额净值增长率	-6.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	114,428,454.49
期末可供分配基金份额利润	1.1756
期末基金资产净值	211,764,808.95
期末基金份额净值	2.176
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	138.79%

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	-2.99%	0.49%	-2.24%	0.36%	-0.75%	0.13%
过去三个月	-3.67%	0.69%	-1.11%	0.56%	-2.56%	0.13%
过去六个月	-6.85%	1.04%	1.83%	0.67%	-8.68%	0.37%
过去一年	-21.64%	0.98%	-5.87%	0.65%	-15.77%	0.33%
过去三年	-48.86%	1.21%	-22.98%	0.78%	-25.88%	0.43%
自基金合同生效起至今	138.79%	1.34%	38.77%	1.02%	100.02%	0.32%

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 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		
罗春蕾	本基金基金经理	2015 年 09 月 26 日	-	17 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，2019 年 1 月至 2024 年 6 月任诺安积极配置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。

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

2024 上半年，A 股整体呈现大幅震荡的走势。先是一月份，在对宏观经济，尤其是地产的悲观预期之下，市场大幅杀跌。然后是二月份，在监管层对量化产品严格监管、限制恶意做空、并且有“国家队救市”的期待之下，A 股强势反弹。四月份，市场对地产放松政策多有期待，包括但不限于政府出资收购新房、各地放开限购、降低房贷利率等，总之通过化解房地产压力来提振经济。进入五月份，中央政府和地方政府相继出台多项政策，虽然都涉及到上文提到的措施，但总体上政策导向是要靠居民加杠杆来托底房市，政府出资和降房贷利率的力度都比较小。但是过去几年，在疫

情因素、地产拖累、行业整顿、企业主动应对经营风险下的裁员降本增效之下，民众对未来收入预期变得谨慎，更倾向于增加储蓄、减少消费、降低杠杆。实际上，5-6 月份的社融信贷数据也反映出居民超额储蓄持续增加，不愿加杠杆买房。因此，前期的反弹逻辑有所松动，A 股再次进入调整。上半年，上证 50、沪深 300 等大盘红利股较多的指数几乎未跌，甚至还有微涨。而中证 1000、科创 50、创业板指、中证 500、中小板等小市值、成长股较多的指数则明显下跌，跌幅均超过 5%，甚至接近 17%。细分行业方面，银行、煤炭、石油石化、家电、电力公用事业等红利特征明显的板块逆势上涨，其中银行指数涨幅达 19%，煤炭、石化、电力涨幅约在 10-13%，家电涨幅超过 10%，在一众消费板块中一枝独秀；而其他大消费、医药、地产链、新能源等行业则跌幅较深，达 12-23%，行业分化显著。

上半年，本基金在一季度认为市场会有一波政策主导救市+期待房地产政策+市场急跌之后的反弹，但也仅仅是反弹。因此本基金通过适当加仓来获取收益。进入二季度，本基金认为市场前期反弹逻辑松动，且无论市场的风格走势、宏观数据、风险偏好程度均指向一个较弱的经济预期，因此判断投资风格应以防御为主，故适当降低仓位来减少损失。上半年，本基金净值下跌 6.85%。与我们主要聚焦的大消费及医药行业指数相比，我们跑输了家电（中信）行业指数（涨幅超 10%），但跑赢了其他所有细分行业指数。

#### 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 2.176 元，本报告期内基金份额净值增长率为-6.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 A 股这种“大市趋弱，红利资产走强，除了少数跟随美股联动的 AI 相关个股强势，地产链、大消费、AI 之外的科技、制造等均走势疲弱”鲜明的市场风格反映了投资者对宏观经济的信心不足，避险情绪浓厚，防御心态远大于进攻。我们之前提到：房地产拖累导致宏观数据低迷、企业经营信心偏弱、居民消费意愿不强、对中长期经济发展趋势的迷茫等因素都是影响 A 股走势的主要因素。考虑到企业、居民的杠杆率已经不算低了，除非政府愿意加杠杆来解决地产问题，同时加大财政支出来提振需求，否则宏观经济的低迷在短期内可能较难看到拐点。因此市场风险偏好大概率是持续偏低的。高端制造业的升级、高科技领域突破“卡脖子”是现阶段国家最为重视的、倾斜资源最多的方向，亦会时不时有捷报传来。我们相信在举国体制、上下同心的努力之下，以中国人的智慧及勤奋，凭借我们的工程师红利，依靠国内巨大的市场和克服种种障碍出海，中国企业一定能突破封锁，获取高科技、高端制造领域的巨大利润。但骐骥千里，非一日之功。我们的产业升级之

路需要时间。在转型期间，上述行业对整体经济的支撑力度有限，尚无法与房地产的体量相比，国内宏观经济的下行压力仍然较大。出口是近两年中国经济的亮点，但在地缘政治的影响下，美欧甚至一些一带一路国家均有对我国部分产业加征关税的趋势。这个负面效应可能从 2024H2 逐渐显现，这导致出口对经济的支撑作用恐将削弱。海外方面，2024 是美国大选之年，随着拜登退选，哈里斯成为民主党候选人，与特朗普竞争新任美国总统之位。这意味着未来 4 年美国对华政策具体如何仍有较多不确定（遏制中国是两党共识，但如何遏制两党手段有差异），市场难以定价（或者说寻找方向）。

因此，从短期来看，市场可能仍将处于风险偏好较低、避险防御为主的行情。这个避险防御为主并非指资金会持续堆积在红利板块，哪怕估值日益高企。而是说，市场在没有增量资金的前提下，很难会为短期无法兑现的梦想、预期付出较高溢价，可能也不会因为一些看不清楚的“便宜、低估值、跌多了”而轻易抄底。我们认为市场更有可能在震荡行情中，在有相对中长期确定性的板块反复轮动，通过不断切换避风港来应对不确定性。

本基金的投资依然聚焦国内大消费及医药领域的优质公司。我们会通过对仓位调整、对公司长期经营趋势的确定性与估值合理性的严格要求来建立组合。我们尽量选择符合这一阶段消费者偏好的细分行业和个股，选择受宏观经济冲击较弱的领域，以期在这一经济调整期给投资人创造稳健的回报。

#### 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

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的真实、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：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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	82,224,823.76	23,875,000.23
结算备付金		298,649.23	449,537.99

存出保证金		136,032.26	135,597.74
交易性金融资产	6.4.7.2	136,007,276.16	222,796,614.53
其中：股票投资		136,007,276.16	222,796,614.53
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		-	1,043,479.18
应收股利		-	-
应收申购款		23,879.73	74,758.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		218,690,661.14	248,374,987.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年06月30日</b>	<b>2023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		5,938,087.59	2,974,548.41
应付赎回款		234,743.94	178,365.73
应付管理人报酬		213,499.40	285,887.45
应付托管费		35,583.22	47,647.90
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	503,938.04	497,802.91
负债合计		6,925,852.19	3,984,252.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	97,336,354.46	104,617,265.91
未分配利润	6.4.7.8	114,428,454.49	139,773,469.64
净资产合计		211,764,808.95	244,390,735.55
负债和净资产总计		218,690,661.14	248,374,987.95

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.176 元，基金份额总额 97,336,354.46 份。

## 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：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
<b>一、营业总收入</b>		-14,972,978.21	-35,745,302.81
1. 利息收入		110,829.81	103,137.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	110,829.81	97,943.58
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		-	5,193.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,277,782.72	-7,198,988.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-48,398,513.33	-9,501,253.51
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	2,120,730.61	2,302,264.87
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	31,189,312.07	-28,747,216.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,662.63	97,765.05
<b>减：二、营业总支出</b>		1,635,513.20	3,271,956.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,329,997.80	2,732,741.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	221,666.32	455,456.85
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	83,849.08	83,759.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,608,491.41	-39,017,259.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,608,491.41	-39,017,259.74
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-16,608,491.41	-39,017,259.74

### 6.3 净资产变动表

会计主体：诺安主题精选混合型证券投资基金

本报告期：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	104,617,265.91	139,773,469.64	244,390,735.55
二、本期期初净资产	104,617,265.91	139,773,469.64	244,390,735.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,280,911.45	-25,345,015.15	-32,625,926.60
（一）、综合收益总额	-	-16,608,491.41	-16,608,491.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,280,911.45	-8,736,523.74	-16,017,435.19
其中：1. 基金申购款	1,976,334.17	2,402,040.28	4,378,374.45
2. 基金赎回款	-9,257,245.62	-11,138,564.02	-20,395,809.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	97,336,354.46	114,428,454.49	211,764,808.95
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	116,779,938.67	239,782,136.63	356,562,075.30
二、本期期初净资产	116,779,938.67	239,782,136.63	356,562,075.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,649,979.35	9,759,091.27	33,409,070.62
（一）、综合收益总额	-	-39,017,259.74	-39,017,259.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	23,649,979.35	48,776,351.01	72,426,330.36
其中：1. 基金申购款	52,359,530.96	107,832,792.55	160,192,323.51
2. 基金赎回款	-28,709,551.61	-59,056,441.54	-87,765,993.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	140,429,918.02	249,541,227.90	389,971,145.92

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

何柳姿

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《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	82,224,823.76
等于：本金	82,217,583.94
加：应计利息	7,239.82
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	82,224,823.76

#### 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	134,790,212.06	-	136,007,276.16	1,217,064.10
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	134,790,212.06	-	136,007,276.16	1,217,064.10

#### 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	57.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	421,831.77
其中：交易所市场	421,831.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
合计	503,938.04

#### 6.4.7.7 实收基金

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	104,617,265.91	104,617,265.91
本期申购	1,976,334.17	1,976,334.17
本期赎回（以“-”号填列）	-9,257,245.62	-9,257,245.62
本期末	97,336,354.46	97,336,354.46

#### 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	220,670,096.51	-80,896,626.87	139,773,469.64
本期期初	220,670,096.51	-80,896,626.87	139,773,469.64
本期利润	-47,797,803.48	31,189,312.07	-16,608,491.41
本期基金份额交易产生的变动数	-12,878,365.11	4,141,841.37	-8,736,523.74
其中：基金申购款	3,504,984.02	-1,102,943.74	2,402,040.28
基金赎回款	-16,383,349.13	5,244,785.11	-11,138,564.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	159,993,927.92	-45,565,473.43	114,428,454.49

#### 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	102,750.54
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	7,022.34
其他	1,056.93
合计	110,829.81

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	691,245,359.93
减：卖出股票成本总额	738,037,041.87
减：交易费用	1,606,831.39
买卖股票差价收入	-48,398,513.33

#### 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	2,120,730.61
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	2,120,730.61

#### 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	31,189,312.07
-- 股票投资	31,189,312.07
-- 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	31,189,312.07

#### 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	4,578.43
其他	84.20
合计	4,662.63

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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	96.30
汇划手续费	1,703.54
合计	83,849.08

#### 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 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	1,329,997.80	2,732,741.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	395,854.81	886,034.74
应支付基金管理人的净管理费	934,142.99	1,846,706.32

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 8 月 28 日前，本基金管理费率为 1.50%。本基金管理人自 2023 年 8 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 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托管费	221,666.32	455,456.85

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 8 月 28 日前，本基金托管费率为 0.25%。本基金管理人自 2023 年 8 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%。

#### 6.4.10.3 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 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	
	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-活期存款	82,224,823.76	102,750.54	37,385,362.87	92,149.89

注：本基金的上述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 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	6个月	新股锁定	17.39	20.60	150	2,608.50	3,090.00	-

		日								
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	156	2,648.88	2,102.88	-
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	173	3,015.39	5,978.88	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
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	星辰科技	2024年03月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	384	6,205.44	12,391.68	-
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	-
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	-
301587	中瑞股份	2024年03月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	257	5,584.61	6,491.82	-
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	6个月	新股锁定	126.89	188.01	463	32,610.73	87,048.63	-
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	320	5,184.00	5,107.20	-
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	97	2,064.16	2,860.53	-
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	936	17,456.40	17,456.40	-

603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	104	1,939.60	1,939.60	-
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	85	2,466.70	2,155.60	-
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	36	2,608.56	2,450.16	-
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	129	2,474.22	2,923.14	-
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	60	2,290.80	2,334.00	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	89	2,078.15	2,236.57	-
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	315	7,137.90	5,005.35	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	222	4,408.92	9,437.22	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	74	6,435.04	12,944.82	-
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	425	6,668.25	7,985.75	-

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“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同责任，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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（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 6 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 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 2024 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货币资金、结算备付金、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	82,224,823.76	-	-	-	-	82,224,823.76
结算备付金	298,649.23	-	-	-	-	298,649.23
存出保证金	136,032.26	-	-	-	-	136,032.26
交易性金融资产	-	-	-	-	136,007,276.16	136,007,276.16
应收申购款	-	-	-	-	23,879.73	23,879.73
资产总计	82,659,505.25	-	-	-	136,031,155.89	218,690,661.14
负债						
应付清算款	-	-	-	-	5,938,087.59	5,938,087.59
应付赎回款	-	-	-	-	234,743.94	234,743.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	213,499.40	213,499.40
应付托管费	-	-	-	-	35,583.22	35,583.22
其他负债	-	-	-	-	503,938.04	503,938.04
负债总计	-	-	-	-	6,925,852.19	6,925,852.19
利率敏感度缺口	82,659,505.25	-	-	-	129,105,303.70	211,764,808.95
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	23,875,000.23	-	-	-	-	23,875,000.23
结算备付金	449,537.99	-	-	-	-	449,537.99
存出保证金	135,597.74	-	-	-	-	135,597.74
交易性金融资产	-	-	-	-	222,796,614.53	222,796,614.53
应收清算款	-	-	-	-	1,043,479.18	1,043,479.18
应收申购款	-	-	-	-	74,758.28	74,758.28
资产总计	24,460,135.96	-	-	-	223,914,851.99	248,374,987.95
负债						
应付清算款	-	-	-	-	2,974,548.41	2,974,548.41
应付赎回款	-	-	-	-	178,365.73	178,365.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	285,887.45	285,887.45
应付托管费	-	-	-	-	47,647.90	47,647.90
其他负债	-	-	-	-	497,802.91	497,802.91
负债总计	-	-	-	-	3,984,252.40	3,984,252.40
利率敏感度缺口	24,460,135.96	-	-	-	219,930,599.59	244,390,735.55

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	136,007,276.16	64.23	222,796,614.53	91.16
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	136,007,276.16	64.23	222,796,614.53	91.16

	6		3
--	---	--	---

#### 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%	5,918,126.99	9,176,364.45
	业绩比较基准下降 5%	-5,918,126.99	-9,176,364.45

#### 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	135,740,309.98	221,894,762.00
第二层次	41,004.56	-
第三层次	225,961.62	901,852.53
合计	136,007,276.16	222,796,614.53

###### 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	136,007,276.16	62.19
	其中：股票	136,007,276.16	62.19
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	82,523,472.99	37.74
8	其他各项资产	159,911.99	0.07
9	合计	218,690,661.14	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	9,178,000.00	4.33
C	制造业	85,402,276.58	40.33
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	9,555,000.00	4.51
G	交通运输、仓储和邮政业	13,425,000.00	6.34
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,892.38	0.08
J	金融业	13,430,000.00	6.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,107.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,836,000.00	2.28
S	综合	-	-
	合计	136,007,276.16	64.23

### 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	000423	东阿阿胶	275,600	17,252,560.00	8.15
2	601816	京沪高铁	2,500,000	13,425,000.00	6.34
3	603486	科沃斯	230,000	10,851,400.00	5.12
4	688575	亚辉龙	450,063	10,495,469.16	4.96
5	600737	中粮糖业	1,000,000	9,590,000.00	4.53
6	601607	上海医药	500,000	9,555,000.00	4.51
7	300866	安克创新	130,000	9,257,300.00	4.37
8	603195	公牛集团	116,000	8,945,920.00	4.22
9	600282	南钢股份	1,500,000	7,470,000.00	3.53
10	600919	江苏银行	1,000,000	7,430,000.00	3.51
11	002966	苏州银行	800,000	6,000,000.00	2.83
12	600489	中金黄金	400,000	5,920,000.00	2.80
13	688085	三友医疗	350,050	5,915,845.00	2.79
14	002739	万达电影	400,000	4,836,000.00	2.28
15	000975	山金国际	200,000	3,258,000.00	1.54
16	300677	英科医疗	80,000	2,144,800.00	1.01
17	600150	中国船舶	52,000	2,116,920.00	1.00
18	689009	九号公司	16,000	588,960.00	0.28
19	600993	马应龙	20,000	533,400.00	0.25
20	688692	达梦数据	732	160,586.86	0.08
21	301589	诺瓦星云	463	87,048.63	0.04
22	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01

23	603285	键邦股份	1,040	19,396.00	0.01
24	301536	星辰科技	384	12,391.68	0.01
25	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
26	688691	灿芯股份	222	9,437.22	0.00
27	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
28	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
29	688709	成都华微	425	7,985.75	0.00
30	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
31	301587	中瑞股份	257	6,491.82	0.00
32	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
33	001389	广合科技	173	5,978.88	0.00
34	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
35	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
36	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
37	601033	永兴股份	320	5,107.20	0.00
38	688584	上海合晶	315	5,005.35	0.00
39	001359	平安电工	150	3,090.00	0.00
40	603344	星德胜	129	2,923.14	0.00
41	603082	北自科技	97	2,860.53	0.00
42	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
43	603325	博隆技术	36	2,450.16	0.00
44	603375	盛景微	60	2,334.00	0.00
45	603381	永臻股份	89	2,236.57	0.00
46	603312	西典新能	85	2,155.60	0.00
47	001379	腾达科技	156	2,102.88	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	600150	中国船舶	23,751,382.00	9.72
2	000423	东阿阿胶	21,632,584.25	8.85
3	688488	艾迪药业	17,415,031.95	7.13
4	300866	安克创新	17,058,299.00	6.98
5	002739	万达电影	15,439,480.00	6.32
6	000975	山金国际	13,971,419.28	5.72
7	000568	泸州老窖	13,263,551.00	5.43
8	601816	京沪高铁	13,055,395.00	5.34
9	688677	海泰新光	11,631,810.38	4.76
10	688575	亚辉龙	11,367,383.49	4.65

11	300979	华利集团	11,041,054.52	4.52
12	601985	中国核电	10,872,594.00	4.45
13	600085	同仁堂	10,835,079.00	4.43
14	603195	公牛集团	10,712,626.60	4.38
15	600941	中国移动	10,576,827.00	4.33
16	600422	昆药集团	10,543,297.00	4.31
17	603439	贵州三力	10,459,009.00	4.28
18	600737	中粮糖业	10,405,386.00	4.26
19	002966	苏州银行	10,031,753.00	4.10
20	300662	科锐国际	9,979,647.00	4.08
21	601857	中国石油	9,806,004.00	4.01
22	002891	中宠股份	9,649,925.00	3.95
23	601607	上海医药	9,569,515.00	3.92
24	603486	科沃斯	9,508,458.84	3.89
25	600547	山东黄金	9,317,553.00	3.81
26	601888	中国中免	9,174,483.00	3.75
27	603583	捷昌驱动	9,053,720.21	3.70
28	300842	帝科股份	9,039,286.39	3.70
29	300418	昆仑万维	8,976,130.28	3.67
30	002155	湖南黄金	8,760,628.98	3.58
31	600489	中金黄金	8,431,779.00	3.45
32	688177	百奥泰	8,115,071.31	3.32
33	600282	南钢股份	8,113,802.00	3.32
34	603365	水星家纺	7,893,301.30	3.23
35	600872	中炬高新	7,642,944.24	3.13
36	600919	江苏银行	7,528,654.00	3.08
37	603288	海天味业	7,479,742.53	3.06
38	600362	江西铜业	7,283,093.35	2.98
39	603087	甘李药业	7,227,918.20	2.96
40	003000	劲仔食品	7,226,523.00	2.96
41	002755	奥赛康	6,916,724.00	2.83
42	300347	泰格医药	6,693,650.00	2.74
43	002737	葵花药业	6,584,812.93	2.69
44	688085	三友医疗	6,430,692.12	2.63
45	600916	中国黄金	6,184,984.00	2.53
46	603993	洛阳钼业	6,127,494.00	2.51
47	689009	九号公司	5,814,988.34	2.38
48	000989	九芝堂	5,786,838.00	2.37
49	002867	周大生	5,565,820.26	2.28
50	002608	江苏国信	5,258,898.00	2.15
51	688336	三生国健	5,134,376.76	2.10

52	688169	石头科技	4,984,213.16	2.04
53	300957	贝泰妮	4,930,375.00	2.02

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600150	中国船舶	23,215,530.00	9.50
2	300896	爱美客	19,714,035.72	8.07
3	000858	五粮液	19,491,448.00	7.98
4	688198	佰仁医疗	18,175,681.87	7.44
5	688488	艾迪药业	16,521,119.79	6.76
6	301498	乖宝宠物	13,630,631.20	5.58
7	000568	泸州老窖	12,916,117.00	5.29
8	600276	恒瑞医药	12,845,066.12	5.26
9	001215	千味央厨	12,817,551.00	5.24
10	688276	百克生物	12,656,705.46	5.18
11	688050	爱博医疗	12,565,212.64	5.14
12	603170	宝立食品	12,520,750.12	5.12
13	300979	华利集团	12,346,374.00	5.05
14	601985	中国核电	11,576,503.00	4.74
15	600085	同仁堂	11,366,051.00	4.65
16	000975	山金国际	11,032,576.72	4.51
17	688180	君实生物	10,748,754.03	4.40
18	688177	百奥泰	10,716,244.98	4.38
19	601857	中国石油	10,388,420.00	4.25
20	600547	山东黄金	10,240,182.56	4.19
21	002739	万达电影	10,120,548.13	4.14
22	600941	中国移动	10,067,026.00	4.12
23	688677	海泰新光	9,837,726.29	4.03
24	603439	贵州三力	9,837,041.00	4.03
25	300413	芒果超媒	9,708,055.00	3.97
26	300662	科锐国际	9,674,316.00	3.96
27	002891	中宠股份	9,640,615.00	3.94
28	688981	中芯国际	9,533,446.19	3.90
29	601888	中国中免	9,491,519.00	3.88
30	688085	三友医疗	9,378,545.15	3.84
31	002155	湖南黄金	9,041,694.18	3.70
32	300842	帝科股份	8,892,061.00	3.64
33	301269	华大九天	8,856,035.36	3.62
34	600422	昆药集团	8,748,079.00	3.58

35	300418	昆仑万维	8,576,770.24	3.51
36	603087	甘李药业	8,443,190.00	3.45
37	603882	金域医学	8,371,270.00	3.43
38	603365	水星家纺	8,204,160.95	3.36
39	600872	中炬高新	8,142,967.34	3.33
40	603707	健友股份	7,840,106.50	3.21
41	600362	江西铜业	7,832,037.74	3.20
42	300866	安克创新	7,673,575.00	3.14
43	603288	海天味业	7,369,011.80	3.02
44	002352	顺丰控股	7,230,234.00	2.96
45	002737	葵花药业	7,136,265.00	2.92
46	003000	劲仔食品	7,038,000.00	2.88
47	300347	泰格医药	6,685,855.00	2.74
48	603993	洛阳钼业	6,305,008.00	2.58
49	600916	中国黄金	6,159,701.00	2.52
50	603583	捷昌驱动	6,043,199.84	2.47
51	002755	奥赛康	5,912,661.70	2.42
52	000989	九芝堂	5,910,408.00	2.42
53	688336	三生国健	5,825,915.79	2.38
54	002867	周大生	5,485,680.00	2.24
55	000423	东阿阿胶	5,406,210.00	2.21
56	002608	江苏国信	5,145,483.00	2.11
57	689009	九号公司	5,044,503.33	2.06
58	688169	石头科技	4,956,432.09	2.03

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	620,058,391.43
卖出股票收入（成交）总额	691,245,359.93

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，江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局江苏监管局的行政处罚。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	136,032.26
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	23,879.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,911.99

#### 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
20,013	4,863.66	22,970,954.89	23.60%	74,365,399.57	76.40%

#### 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	711,932.90	0.7314%

#### 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	104,617,265.91
本报告期基金总申购份额	1,976,334.17
减：本报告期基金总赎回份额	9,257,245.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	97,336,354.46

## § 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	263,748,233.30	20.13%	246,841.08	20.97%	-
国海证券	1	315,392,157.86	24.07%	298,546.18	25.36%	-
华金证券	1	284,351,622.01	21.70%	209,255.71	17.77%	-
申万宏源 证券	1	446,827,858.22	34.10%	422,655.08	35.90%	-
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) 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
- (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

3	诺安主题精选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站	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
6	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
7	诺安主题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
8	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
9	诺安主题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
10	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
11	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金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年06月07日
12	诺安主题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06月14日
13	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  
2024 年 08 月 30 日