诺安多策略混合型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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：2026 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 17
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 21
7.4 报表附注 22
§8 投资组合报告 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
8.3 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 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 90
8.6 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 90
8.7 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 90

8.8 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 90
8.9 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 90
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 90
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 90
8.12 投资组合报告附注 90
§9 基金份额持有人信息 91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 92
9.3 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 92
§10 开放式基金份额变动 92
§11 重大事件揭示 92
11.1 基金份额持有人大会决议 92
11.2 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 93
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 93
11.4 基金投资策略的改变 93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 93
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 94
11.8 其他重大事件 95
§12 影响投资者决策的其他重要信息 101
12.1 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 101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 102
§13 备查文件目录 102
13.1 备查文件目录 102
13.2 存放地点 102
13.3 查阅方式 102

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安多策略混合型证券投资基金	
基金简称	诺安多策略混合	
基金主代码	320016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 08 月 09 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	1,272,154,310.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
下属分级基金的交易代码	320016	023350
报告期末下属分级基金的份额总额	642,343,723.00 份	629,810,587.76 份

注：①自 2015 年 8 月 6 日起，原“诺安多策略股票型证券投资基金”变更为“诺安多策略混合型证券投资基金”。

②自 2025 年 2 月 11 日起，本基金分设 A 类基金份额和 C 类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过数量化手段优化投资策略，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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、权证投资策略以及股指期货投资策略六个部分组成。 1.资产配置策略 本基金主要投资的大类资产是股票、债券和现金，我们将从宏观面、政策面、资金面和基本面等全面研究、综合分析，发掘择时因子，根据择时因子信号和市场情况灵活配置大类资产。 2.股票投资策略 本基金以“定量投资”为主，辅以“定性投资”，力争实现稳定超额回报。 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。 4.债券投资策略 本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。 5.权证投资策略 本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，进

	行稳健投资。 6.股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎性原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%
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、中高预期收益的品种。

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
本期已实现收益	630,357,557.86	540,824,313.86	-96,188,172.87	-	20,008,163.46	-
本期利润	643,862,485.27	427,699,654.59	-133,887,919.96	-	21,097,396.75	-
加权平均基金份额本期利润	1.2584	0.9433	-0.6758	-	0.4285	-
本期加权平均净值利润率	43.88%	31.23%	-42.32%	-	25.05%	-
本期基金份额净值增长率	70.98%	57.02%	7.46%	-	5.52%	-
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
期末可供分配利润	1,293,681,833.57	1,261,141,474.04	234,101,670.85	-	239,074,446.08	-
期末可供分配基金份额利润	2.0140	2.0024	0.9010	-	0.7963	-
期末基金资产净值	2,119,818,730.48	2,071,101,298.69	501,342,874.41	-	539,312,599.38	-
期末基金份额净值	3.300	3.288	1.930	-	1.796	-
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
基金份额累计净值增长率	230.00%	57.02%	93.00%	-	79.60%	-

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

诺安多策略混合 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
过去三个月	6.62%	1.19%	-0.08%	0.71%	6.70%	0.48%
过去六个月	21.59%	1.15%	12.94%	0.68%	8.65%	0.47%
过去一年	70.98%	1.49%	13.49%	0.72%	57.49%	0.77%
过去三年	93.89%	1.97%	18.91%	0.80%	74.98%	1.17%
过去五年	49.80%	1.70%	-2.32%	0.85%	52.12%	0.85%
自基金合同生效起至今	230.00%	1.58%	78.31%	1.01%	151.69%	0.57%

诺安多策略混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.51%	1.19%	-0.08%	0.71%	6.59%	0.48%
过去六个月	21.33%	1.15%	12.94%	0.68%	8.39%	0.47%
自基金合同生效起至今	57.02%	1.42%	14.38%	0.71%	42.64%	0.71%

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

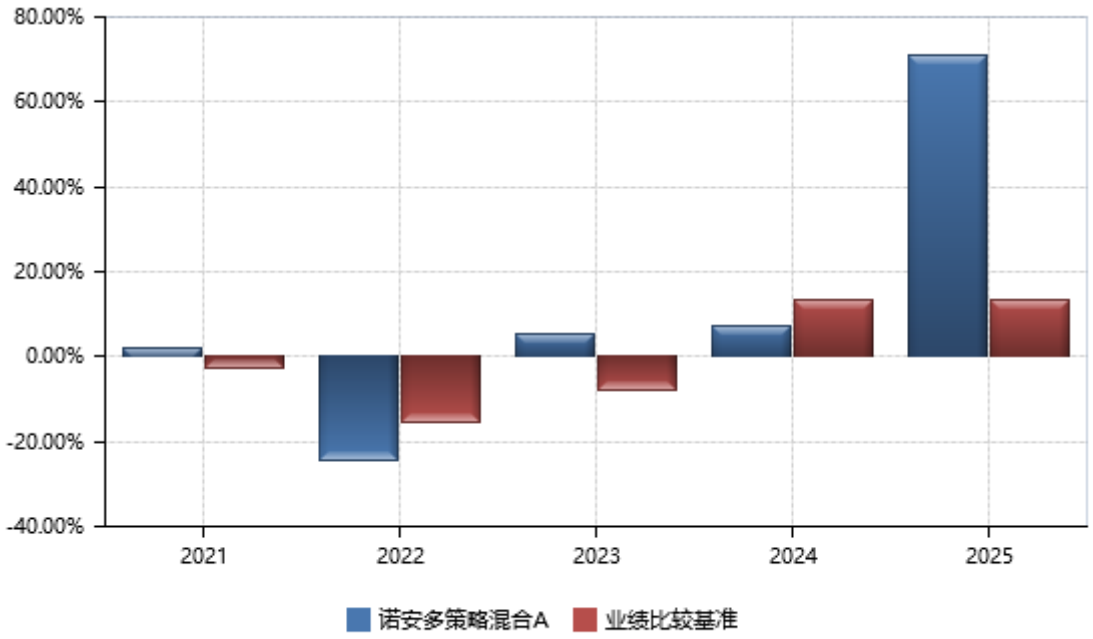
诺安多策略混合 A

诺安多策略混合 C

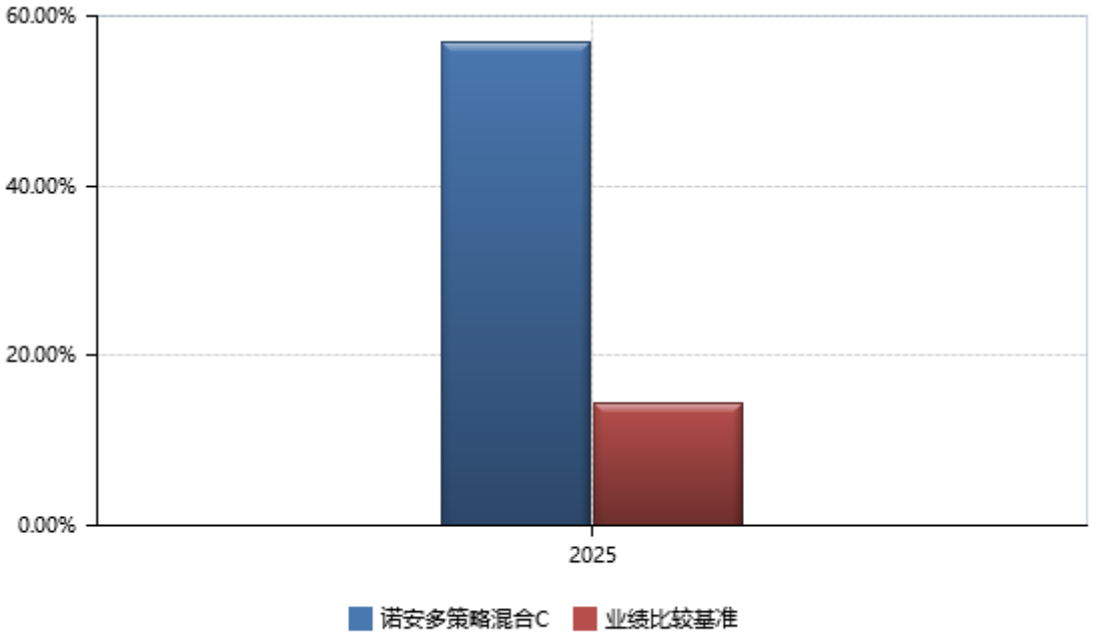
注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安多策略混合 A



诺安多策略混合 C



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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 2025 年 12 月 31 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 A100 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		

王海畅	本基金基金经理	2022 年 11 月 03 日	2025 年 11 月 08 日	9 年	硕士，具有基金从业资格。2017 年 1 月至 2025 年 11 月任职诺安基金管理有限公司，历任研究员。2022 年 11 月至 2024 年 1 月任诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2022 年 7 月至 2024 年 8 月任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2025 年 11 月任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月至 2025 年 11 月任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
孔宪政	本基金基金经理	2023 年 02 月 21 日	-	14 年	博士，具有基金从业资格。历任野村证券交易员、白湾基金投资经理、前海开源基金投资部副总监、兴证证券资产管理有限公司投资部投资经理、蜂巢基金管理有限公司基金经理。2021 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，历任多资产投资部总经理兼国际业务部总经理，现任多资产投资部总经理。2023 年 2 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安汇利灵活配置混合型

					证券投资基金基金经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2023 年 6 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金及诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期、离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期、解聘日期；

②证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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 公平交易制度和控制方法

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，并下达申购指令。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3 日内、5 日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 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

报告期内本产品积极看多股票资产，持续高仓位、分散化运作，继续在股票中勤奋寻找价值回归的机会。获益于多个领域的不同机会，最终在较低回撤的基础上获取了较好收益。夏普比率和卡玛比率表现均较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安多策略混合 A 份额净值为 3.300 元，本报告期诺安多策略混合 A 份额净值增长率为 70.98%，同期业绩比较基准收益率为 13.49%；截至本报告期末诺安多策略混合 C 份额净值为 3.288 元，本报告期诺安多策略混合 C 份额净值增长率为 57.02%，同期业绩比较基准收益率为 14.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，国内经济数据总体稳健，上半年的关税冲击已趋于缓和，且下半年出现一定需求端

政策发力加码的迹象，尤其大范围“反内卷”的供给侧改革持续发力使得短期有望看到通胀数据重回政策目标区间并给企业利润提供空间。行业层面上半年表现并不理想的周期品出现估值的快速修复和悲观情绪转暖，下半年至今涨价逻辑刺激部分行业出现较大涨幅。在物价层面出现向上拐点的阶段，结合《“十五五”规划建议》中将“建设强大国内市场”放到了核心的位置，股票资产整体估值也较基本面提前出现趋势性上升。未来一年内，市场波动相比本次报告期内有一定概率会出现明显放大，而部分追逐高弹性资产的资金将在市场风险放大后回流至稳健类资产。长期来看，未来国内投资仍面临低利率和资产荒的环境约束，政策围绕“建设国内市场”具体会出台什么样的措施将会是下一年市场核心的预期差所在。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在内部监察稽核工作中，本基金管理人始终坚守合法合规、基金份额持有人利益至上的核心宗旨，构建多层级、多维度的合规风控体系。严格遵循独立、客观、公正原则，依照监察稽核工作计划及流程规范履职，确保勤勉尽责管理基金资产。本年度工作开展情况如下：

在合规管理方面，扎实推进法律法规、高质量发展行动方案等重要政策法规落地执行，持续加强全员合规培训，不断优化内部制度体系、内部控制体系、内部审计体系及廉洁文化建设，从源头筑牢合规经营防线。

在风险控制方面，常态化监督基金日常投资运作，强化流动性风险管理，完善压力测试机制与应急预案，保障基金资产合规稳健运行。

在监察稽核方面，采用定期稽核与专项稽核相结合方式，对公司治理、投研交易、销售运营、信息技术、反洗钱等关键环节实现全覆盖检查，对发现问题推动整改闭环管理。

在宣传推介方面，公司严格履行适当性管理相关要求，积极践行社会责任，多措并举开展投资者教育工作。

本基金管理人将始终秉持诚实信用、勤勉尽责原则，坚守合规底线，稳健经营、严控风险，全力为基金份额持有人谋求长期稳定收益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0183 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺安多策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了诺安多策略混合型证券投资基金（以下简称“诺安多策略基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了诺安多策略基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于诺安多策略基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	诺安多策略基金的基金管理人诺安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括诺安多策略基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估诺安多策略

	基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算诺安多策略基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督诺安多策略基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对诺安多策略基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安多策略基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	周祎　　崔泽宇
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026 年 03 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金
报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	342,888,830.75	39,298,078.29
结算备付金		16,869,246.96	1,139,374.45
存出保证金		1,525,456.14	139,621.62
交易性金融资产	7.4.7.2	3,946,529,767.06	475,281,284.29
其中：股票投资		3,946,529,767.06	475,281,284.29
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		14,942,962.11	1,525,794.48
应收股利		-	-
应收申购款		18,253,270.44	5,164,379.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		4,341,009,533.46	522,548,532.29
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		142,492,297.71	20,139,477.04
应付管理人报酬		4,682,546.68	595,769.24
应付托管费		780,424.43	99,294.90
应付销售服务费		817,905.41	-
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	7.4.7.6	1,316,330.06	371,116.70
负债合计		150,089,504.29	21,205,657.88
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,272,154,310.76	259,811,667.77
未分配利润	7.4.7.8	2,918,765,718.41	241,531,206.64
净资产合计		4,190,920,029.17	501,342,874.41
负债和净资产总计		4,341,009,533.46	522,548,532.29

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，诺安多策略混合 A 基金份额净值 3.300 元，基金份额总额 642,343,723.00 份；诺安多策略混合 C 基金份额净值 3.288 元，基金份额总额 629,810,587.76 份。诺安多策略混合份额总额合计为 1,272,154,310.76 份。

7.2 利润表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金
本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,113,447,742.38	-129,369,693.10
1.利息收入		797,199.42	123,604.00
其中：存款利息收入	7.4.7.9	797,199.42	123,604.00
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）		1,194,220,594.51	-95,663,859.57
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,182,087,981.38	-97,549,623.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	2,060.48
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	12,132,613.13	1,883,703.27
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-99,619,731.86	-37,699,747.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	18,049,680.31	3,870,309.56
减：二、营业总支出		41,885,602.52	4,518,226.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	31,625,102.91	3,739,316.38

2．托管费	7.4.10.2.2	5,270,850.53	623,219.40
3．销售服务费	7.4.10.2.3	4,793,041.36	-
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	7.4.7.16	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	7.4.7.17	196,607.72	155,691.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,071,562,139.86	-133,887,919.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,071,562,139.86	-133,887,919.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,071,562,139.86	-133,887,919.96

7.3 净资产变动表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	259,811,667.77	241,531,206.64	501,342,874.41
二、本期期初净资产	259,811,667.77	241,531,206.64	501,342,874.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,012,342,642.99	2,677,234,511.77	3,689,577,154.76
（一）、综合收益总额	-	1,071,562,139.86	1,071,562,139.86
（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）	1,012,342,642.99	1,605,672,371.91	2,618,015,014.90
其中：1.基金申购款	4,200,189,613.68	7,810,791,723.92	12,010,981,337.60
2.基金赎回款	- 3,187,846,970.69	- 6,205,119,352.01	-9,392,966,322.70
（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	1,272,154,310.76	2,918,765,718.41	4,190,920,029.17
项目	**上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	300,238,153.30	239,074,446.08	539,312,599.38
二、本期期初净资产	300,238,153.30	239,074,446.08	539,312,599.38

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-40,426,485.53	2,456,760.56	-37,969,724.97
（一）、综合收益总额	-	-133,887,919.96	-133,887,919.96
（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）	-40,426,485.53	136,344,680.52	95,918,194.99
其中：1.基金申购款	1,165,808,632.67	746,417,018.97	1,912,225,651.64
2.基金赎回款	-1,206,235,118.20	-610,072,338.45	-1,816,307,456.65
（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	259,811,667.77	241,531,206.64	501,342,874.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安多策略混合型证券投资基金(原名为“诺安多策略股票型证券投资基金”，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2011〕739 号《关于核准诺安多策略股票型证券投资基金募集的批复》核准，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》和《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,248,834,629.84 元。经向中国证监会备案，《诺安多策略股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 8 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,249,071,475.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 236,845.34 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，诺安多策略股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为诺安多策略混合型证券投资基金。

根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于 2025 年 2 月 11 日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安多策略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》以及更新的《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2025 年 2 月 11 日起，本基金增加基金份额类别。本基金增加基金份额类别后，设 A 类基金份额和 C 类基金份额两类基金份额。其中，A 类基金份额在申购时收取申购费用、在赎回时根据持有期限

收取赎回费用，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、在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且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 类基金份额和 C 类基金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》和《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券、权证、货币市场工具、股指期货和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+上证国债指数×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负

债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、存托凭证、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要

求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣

除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为相应类别的基金份额；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

4、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

7、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确

定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字〔2022〕566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	342,888,830.75	39,298,078.29
等于：本金	342,857,457.14	39,290,960.38
加：应计利息	31,373.61	7,117.91
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	342,888,830.75	39,298,078.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,082,700,893.87	-	3,946,529,767.06	-136,171,126.81

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		4,082,700,893.87	-	3,946,529,767.06	-136,171,126.81
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		511,832,679.24	-	475,281,284.29	-36,551,394.95
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		511,832,679.24	-	475,281,284.29	-36,551,394.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	103,965.04	70,998.38
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,032,365.02	155,118.32
其中：交易所市场	1,032,365.02	155,118.32
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	145,000.00
合计	1,316,330.06	371,116.70

7.4.7.7 实收基金

诺安多策略混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	259,811,667.77	259,811,667.77
本期申购	1,640,344,675.37	1,640,344,675.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,257,812,620.14	-1,257,812,620.14
本期末	642,343,723.00	642,343,723.00

诺安多策略混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	2,559,844,938.31	2,559,844,938.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,930,034,350.55	-1,930,034,350.55
本期末	629,810,587.76	629,810,587.76

7.4.7.8 未分配利润

诺安多策略混合 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	234,101,670.85	7,429,535.79	241,531,206.64
本期期初	234,101,670.85	7,429,535.79	241,531,206.64
本期利润	630,357,557.86	13,504,927.41	643,862,485.27
本期基金份额交易产生的变动数	429,222,604.86	162,858,710.71	592,081,315.57
其中：基金申购款	2,377,973,754.43	494,282,368.18	2,872,256,122.61
基金赎回款	-1,948,751,149.57	-331,423,657.47	-2,280,174,807.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,293,681,833.57	183,793,173.91	1,477,475,007.48

诺安多策略混合 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	540,824,313.86	-113,124,659.27	427,699,654.59
本期基金份额交易产生的变动数	720,317,160.18	293,273,896.16	1,013,591,056.34
其中：基金申购款	4,080,727,338.40	857,808,262.91	4,938,535,601.31
基金赎回款	-3,360,410,178.22	-564,534,366.75	-3,924,944,544.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,261,141,474.04	180,149,236.89	1,441,290,710.93

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	755,308.75	100,427.17
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	37,763.14	19,869.46
其他	4,127.53	3,307.37
合计	797,199.42	123,604.00

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日

	31 日	
卖出股票成交总额	15,711,660,669.30	2,021,856,726.22
减：卖出股票成本总额	14,516,309,208.58	2,116,034,181.12
减：交易费用	13,263,479.34	3,372,168.42
买卖股票差价收入	1,182,087,981.38	-97,549,623.32

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益--利息收入	-	2,765.48
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-705.00
债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	-	2,060.48

7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	508,087.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	501,355.00
减：应计利息总额	-	7,437.26
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-705.00

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年

	12 月 31 日	12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	12,132,613.13	1,883,703.27
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	12,132,613.13	1,883,703.27

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-99,619,731.86	-37,699,747.09
--股票投资	-99,619,731.86	-37,699,747.09
--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	-99,619,731.86	-37,699,747.09

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	17,603,956.01	3,751,278.90
其他	445,724.30	119,030.66
合计	18,049,680.31	3,870,309.56

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月

	31 日	31 日
审计费用	60,000.00	25,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	16,247.72	10,331.08
账户维护费	360.00	360.00
合计	196,607.72	155,691.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市捷隆投资有限公司	基金管理人的股东
大恒新纪元科技股份有限公司	基金管理人的股东
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司
诺安控股（香港）有限公司	基金管理人的子公司
诺安基金（香港）有限公司	基金管理人子公司控股的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	31,625,102.91	3,739,316.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,056,662.27	1,292,364.68
应支付基金管理人的净管理费	20,568,440.64	2,446,951.70

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×1.20%÷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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,270,850.53	623,219.40

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×0.20%÷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

7.4.10.2.3 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	376,320.15	376,320.15
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	376,320.15	376,320.15

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	-	-
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金诺安多策略混合 A 份额不收取销售服务费，诺安多策略混合 C 份额的年销售服务费年费率为 0.40%。

诺安多策略混合 C 的销售服务费计算方法如下：

H=E×0.40%÷当年天数

H 为诺安多策略混合 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安多策略混合 C 前一日的基金资产净值

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	342,888,830.75	755,308.75	39,298,078.29	100,427.17

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末 2025 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025 年 07 月 23 日	6 个月	新股锁定	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股锁定	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立	2025 年	6 个月	新股锁	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-

	科密	09 月 23 日		定						
001369	双欣材料	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股锁定	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 07 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025 年 09 月 23 日	6 个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 09 月 03 日	6 个月	新股锁定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025 年 09 月 18 日	6 个月	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年 07 月 16 日	6 个月	新股锁定	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025 年 09 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025 年 09 月 15	6 个月	新股锁定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-

		日								
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 09 日	6 个月	新股锁定	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股锁定	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025 年 07 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 08 月 27 日	6 个月	新股锁定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 07 月 30 日	6 个月	新股锁定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025 年 09 月 16 日	6 个月	新股锁定	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025 年 07 月 01 日	6 个月	新股锁定	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-

688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	29.06	52.62	3,529	102,552.74	185,695.98	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股锁定	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 09 日	6 个月	新股锁定	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁定	114.28	416.18	2,321	265,243.88	965,953.78	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 02 日	6 个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	6 个月	新股锁定	104.66	399.31	814	85,193.24	325,038.34	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。本基金在日常投资管理中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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资（2024 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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。

7.4.13.3.1 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时间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 7.4.12。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 2025 年 12 月 31 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符合法律法规的相关要求。

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 2025 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	342,888,830.75	-	-	-	-	342,888,830.75
结算备付金	16,869,246.96	-	-	-	-	16,869,246.96
存出保证金	1,525,456.14	-	-	-	-	1,525,456.14

交易性金融资产	-	-	-	-	3,946,529,767.06	3,946,529,767.06
应收清算款	-	-	-	-	14,942,962.11	14,942,962.11
应收申购款	-	-	-	-	18,253,270.44	18,253,270.44
资产总计	361,283,533.85	-	-	-	3,979,725,999.61	4,341,009,533.46
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	142,492,297.71	142,492,297.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,682,546.68	4,682,546.68
应付托管费	-	-	-	-	780,424.43	780,424.43
应付销售服务费	-	-	-	-	817,905.41	817,905.41
其他负债	-	-	-	-	1,316,330.06	1,316,330.06
负债总计	-	-	-	-	150,089,504.29	150,089,504.29
利率敏感度缺口	361,283,533.85	-	-	-	3,829,636,495.32	4,190,920,029.17
上年度末 2024 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	39,298,078.29	-	-	-	-	39,298,078.29
结算备付金	1,139,374.45	-	-	-	-	1,139,374.45
存出保证金	139,621.62	-	-	-	-	139,621.62
交易性金融资产	-	-	-	-	475,281,284.29	475,281,284.29
应收清算款	-	-	-	-	1,525,794.48	1,525,794.48
应收申购款	-	-	-	-	5,164,379.16	5,164,379.16
资产总计	40,577,074.36	-	-	-	481,971,457.93	522,548,532.29
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	20,139,477.04	20,139,477.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	595,769.24	595,769.24
应付托管费	-	-	-	-	99,294.90	99,294.90
其他负债	-	-	-	-	371,116.70	371,116.70
负债总计	-	-	-	-	21,205,657.88	21,205,657.88
利率敏感度缺口	40,577,074.36	-	-	-	460,765,800.05	501,342,874.41

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，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，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%，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%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	3,946,529,767.06	94.17	475,281,284.29	94.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,946,529,767.06	94.17	475,281,284.29	94.80

7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	197,337,865.00	27,125,966.99

	业绩比较基准下降 5%	-197,337,865.00	-27,125,966.99

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	3,943,911,441.98	471,669,988.11
第二层次	-	3,113,294.50
第三层次	2,618,325.08	498,001.68
合计	3,946,529,767.06	475,281,284.29

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	498,001.68	498,001.68

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,217,760.36	1,217,760.36
转出第三层次	-	1,076,570.84	1,076,570.84
当期利得或损失总额	-	1,979,133.88	1,979,133.88
其中：计入损益的利得或损失	-	1,979,133.88	1,979,133.88
期末余额	-	2,618,325.08	2,618,325.08
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,597,378.33	1,597,378.33

项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	108,247.58	108,247.58
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	407,493.76	407,493.76
转出第三层次	-	461,102.91	461,102.91
当期利得或损失总额	-	443,363.25	443,363.25
其中：计入损益的利得或损失	-	443,363.25	443,363.25
期末余额	-	498,001.68	498,001.68
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	304,173.55	304,173.55

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估值	不可观察输入值

	值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	2,618,325.08	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.00%~307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	498,001.68	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%~574.44%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,946,529,767.06	90.91
	其中：股票	3,946,529,767.06	90.91
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	359,758,077.71	8.29
8	其他各项资产	34,721,688.69	0.80

9	合计	4,341,009,533.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	55,223,335.60	1.32
B	采矿业	103,284.72	0.00
C	制造业	2,761,476,537.38	65.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,691,782.00	1.33
E	建筑业	82,138,764.10	1.96
F	批发和零售业	149,814,398.64	3.57
G	交通运输、仓储和邮政业	55,679,154.80	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	296,969,511.07	7.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	40,038,070.00	0.96
L	租赁和商务服务业	42,043,189.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	240,683,024.90	5.74
N	水利、环境和公共设施管理业	152,903,430.85	3.65
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	13,765,284.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	3,946,529,767.06	94.17

8.3 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	603028	赛福天	1,854,970	17,288,320.40	0.41
2	603331	百达精工	1,194,100	17,015,925.00	0.41
3	002921	联诚精密	956,600	16,281,332.00	0.39
4	688448	磁谷科技	335,469	16,260,182.43	0.39
5	001231	农心科技	645,300	16,093,782.00	0.38

6	002949	华阳国际	1,030,300	16,021,165.00	0.38
7	688455	科捷智能	785,400	15,778,686.00	0.38
8	300103	达刚控股	1,953,100	15,683,393.00	0.37
9	688369	致远互联	616,200	15,669,966.00	0.37
10	603332	苏州龙杰	1,126,082	15,630,018.16	0.37
11	300599	雄塑科技	1,902,800	15,507,820.00	0.37
12	300449	汉邦高科	2,035,100	15,507,462.00	0.37
13	300778	新城市	1,104,782	15,334,374.16	0.37
14	603819	神力股份	1,259,400	15,289,116.00	0.36
15	001373	翔腾新材	472,800	15,261,984.00	0.36
16	301505	苏州规划	683,000	15,210,410.00	0.36
17	300936	中英科技	387,500	15,112,500.00	0.36
18	300971	博亚精工	612,666	14,985,810.36	0.36
19	301555	惠柏新材	447,500	14,959,925.00	0.36
20	300780	德恩精工	775,000	14,942,000.00	0.36
21	603787	新日股份	1,060,600	14,912,036.00	0.36
22	301198	喜悦智行	1,186,980	14,908,468.80	0.36
23	688022	瀚川智能	973,800	14,899,140.00	0.36
24	603272	联翔股份	739,500	14,871,345.00	0.35
25	605336	帅丰电器	944,300	14,863,282.00	0.35
26	300838	浙江力诺	972,500	14,830,625.00	0.35
27	301131	聚赛龙	307,200	14,828,544.00	0.35
28	605001	威奥股份	1,934,130	14,757,411.90	0.35
29	300828	锐新科技	876,650	14,754,019.50	0.35
30	688096	京源环保	1,867,278	14,751,496.20	0.35
31	301135	瑞德智能	524,600	14,741,260.00	0.35
32	301197	工大科雅	707,100	14,735,964.00	0.35
33	603617	君禾股份	1,953,100	14,726,374.00	0.35
34	301233	盛帮股份	278,100	14,717,052.00	0.35
35	603320	迪贝电气	770,700	14,689,542.00	0.35
36	688118	普元信息	575,500	14,686,760.00	0.35
37	300647	超频三	2,130,900	14,681,901.00	0.35
38	603321	梅轮电梯	1,826,100	14,681,844.00	0.35
39	300730	科创信息	1,096,200	14,667,156.00	0.35
40	603700	宁水集团	1,078,500	14,656,815.00	0.35
41	002576	通达动力	841,400	14,640,360.00	0.35
42	300645	正元智慧	780,976	14,627,680.48	0.35
43	300564	筑博设计	923,800	14,549,850.00	0.35
44	688485	九州一轨	814,542	14,531,429.28	0.35
45	300992	泰福泵业	537,800	14,520,600.00	0.35
46	300501	海顺新材	944,300	14,466,676.00	0.35

47	688045	必易微	373,265	14,441,622.85	0.34
48	301063	海锅股份	591,500	14,438,515.00	0.34
49	603289	泰瑞机器	1,425,600	14,427,072.00	0.34
50	000573	粤宏远 A	3,493,100	14,426,503.00	0.34
51	301512	智信精密	329,800	14,425,452.00	0.34
52	002136	安纳达	1,188,000	14,422,320.00	0.34
53	300538	同益股份	896,700	14,418,936.00	0.34
54	603045	福达合金	733,700	14,417,205.00	0.34
55	000159	国际实业	2,494,200	14,416,476.00	0.34
56	300549	优德精密	764,000	14,409,040.00	0.34
57	300746	汉嘉数智	1,136,911	14,404,662.37	0.34
58	688216	气派科技	645,297	14,377,217.16	0.34
59	001202	炬申股份	906,480	14,376,772.80	0.34
60	603282	亚光股份	724,600	14,376,064.00	0.34
61	688309	恒誉环保	595,510	14,369,656.30	0.34
62	688565	力源科技	1,283,584	14,363,304.96	0.34
63	603378	亚士创能	2,108,500	14,358,885.00	0.34
64	600235	民丰特纸	2,111,600	14,358,880.00	0.34
65	301106	骏成科技	482,200	14,355,094.00	0.34
66	300417	南华仪器	1,025,700	14,349,543.00	0.34
67	301072	中捷精工	635,381	14,308,780.12	0.34
68	300665	飞鹿股份	1,465,800	14,306,208.00	0.34
69	301115	联检科技	904,800	14,304,888.00	0.34
70	603637	镇海股份	1,314,800	14,291,876.00	0.34
71	300371	汇中股份	1,136,100	14,280,777.00	0.34
72	300597	吉大通信	1,544,799	14,273,942.76	0.34
73	300854	中兰环保	847,000	14,263,480.00	0.34
74	300800	力合科技	1,226,400	14,263,032.00	0.34
75	301163	宏德股份	532,300	14,260,317.00	0.34
76	603161	科华控股	1,037,140	14,239,932.20	0.34
77	603860	中公高科	471,700	14,231,189.00	0.34
78	300610	晨化股份	1,225,300	14,225,733.00	0.34
79	300823	建科智能	910,700	14,225,134.00	0.34
80	301314	科瑞思	338,440	14,221,248.80	0.34
81	000590	古汉医药	1,268,405	14,218,820.05	0.34
82	605180	华生科技	977,220	14,218,551.00	0.34
83	600128	苏豪弘业	1,291,900	14,197,981.00	0.34
84	301418	协昌科技	388,400	14,176,600.00	0.34
85	003017	大洋生物	474,680	14,173,944.80	0.34
86	300112	万讯自控	1,644,300	14,157,423.00	0.34
87	003042	中农联合	880,450	14,140,027.00	0.34

88	300243	瑞丰高材	1,355,410	14,136,926.30	0.34
89	300694	蠡湖股份	1,170,200	14,136,016.00	0.34
90	300865	大宏立	518,900	14,129,647.00	0.34
91	300675	建科院	904,200	14,123,604.00	0.34
92	688573	信宇人	619,700	14,122,963.00	0.34
93	300912	凯龙高科	855,700	14,119,050.00	0.34
94	300554	三超新材	608,700	14,115,753.00	0.34
95	603810	丰山集团	883,660	14,112,050.20	0.34
96	002775	文科股份	3,296,300	14,108,164.00	0.34
97	600356	恒丰纸业	1,606,700	14,106,826.00	0.34
98	300615	欣天科技	1,062,200	14,106,016.00	0.34
99	301298	东利机械	891,600	14,105,112.00	0.34
100	301313	凡拓数创	531,700	14,095,367.00	0.34
101	300923	研奥股份	551,750	14,086,177.50	0.34
102	300713	英可瑞	814,100	14,083,930.00	0.34
103	600099	林海股份	1,347,600	14,082,420.00	0.34
104	300556	丝路视觉	741,400	14,079,186.00	0.34
105	300987	川网传媒	837,930	14,077,224.00	0.34
106	003003	天元股份	1,064,600	14,074,012.00	0.34
107	300412	迦南科技	2,629,670	14,068,734.50	0.34
108	301378	通达海	495,300	14,066,520.00	0.34
109	603102	百合股份	327,200	14,059,784.00	0.34
110	688618	三旺通信	527,300	14,057,818.00	0.34
111	603073	彩蝶实业	748,100	14,056,799.00	0.34
112	300845	捷安高科	1,247,120	14,055,042.40	0.34
113	002890	弘宇股份	962,500	14,052,500.00	0.34
114	300707	威唐工业	854,200	14,051,590.00	0.34
115	000619	海螺新材	2,261,300	14,042,673.00	0.34
116	300305	裕兴股份	2,360,100	14,042,595.00	0.34
117	301337	亚华电子	510,300	14,038,353.00	0.33
118	001230	劲旅环境	644,100	14,034,939.00	0.33
119	603937	丽岛新材	1,170,200	14,030,698.00	0.33
120	002887	绿茵生态	1,498,700	14,027,832.00	0.33
121	300717	华信新材	736,700	14,026,768.00	0.33
122	603488	展鹏科技	1,798,000	14,024,400.00	0.33
123	603717	天域生物	1,788,800	14,024,192.00	0.33
124	001218	丽臣实业	615,568	14,022,639.04	0.33
125	603318	水发燃气	2,092,800	14,021,760.00	0.33
126	001228	永泰运	534,300	14,020,032.00	0.33
127	300335	迪森股份	2,433,700	14,018,112.00	0.33
128	688681	科汇股份	797,379	14,017,922.82	0.33

129	002809	红墙股份	1,311,155	14,016,246.95	0.33
130	001209	洪兴股份	671,600	14,009,576.00	0.33
131	300240	飞力达	1,857,500	14,005,550.00	0.33
131	600051	宁波联合	1,857,500	14,005,550.00	0.33
133	603968	醋化股份	1,253,800	14,004,946.00	0.33
134	301390	经纬股份	419,900	14,003,665.00	0.33
135	301287	康力源	335,500	13,997,060.00	0.33
136	603029	天鹅股份	767,300	13,995,552.00	0.33
137	603768	常青股份	1,206,400	13,994,240.00	0.33
138	605258	协和电子	447,500	13,993,325.00	0.33
139	688288	鸿泉技术	521,841	13,990,557.21	0.33
140	002857	三晖电气	674,500	13,989,130.00	0.33
141	300649	杭州园林	973,770	13,983,337.20	0.33
142	600847	万里股份	1,203,300	13,982,346.00	0.33
143	603725	天安新材	1,511,600	13,982,300.00	0.33
144	603385	惠达卫浴	2,044,000	13,980,960.00	0.33
145	688021	奥福科技	761,859	13,980,112.65	0.33
146	603041	美思德	1,159,556	13,972,649.80	0.33
147	002998	优彩资源	1,850,100	13,968,255.00	0.33
148	300514	友讯达	1,057,400	13,968,254.00	0.33
149	300732	设研院	1,862,420	13,968,150.00	0.33
150	301353	普莱得	524,972	13,964,255.20	0.33
151	300176	鸿特科技	2,092,800	13,958,976.00	0.33
152	301519	舜禹股份	1,039,400	13,948,748.00	0.33
153	002999	天禾股份	2,041,140	13,940,986.20	0.33
154	600883	博闻科技	1,729,400	13,938,964.00	0.33
155	300928	华安鑫创	447,400	13,936,510.00	0.33
156	300535	达威股份	780,100	13,932,586.00	0.33
157	688517	金冠电气	893,300	13,926,547.00	0.33
158	301222	浙江恒威	488,300	13,926,316.00	0.33
159	300246	宝莱特	1,718,750	13,921,875.00	0.33
160	300074	华平股份	3,019,900	13,921,739.00	0.33
161	603182	嘉华股份	879,900	13,920,018.00	0.33
162	300804	广康生化	397,600	13,916,000.00	0.33
163	002144	宏达高科	1,096,200	13,910,778.00	0.33
164	301156	美农生物	794,310	13,908,368.10	0.33
165	300575	中旗股份	2,384,100	13,899,303.00	0.33
166	300637	扬帆新材	1,195,100	13,899,013.00	0.33
167	301045	天禄科技	523,800	13,896,414.00	0.33
168	300461	田中精机	728,300	13,895,964.00	0.33
169	002381	双箭股份	2,108,500	13,895,015.00	0.33

170	603578	三星新材	1,150,150	13,893,812.00	0.33
171	600615	鑫源智造	1,242,700	13,893,386.00	0.33
172	600539	狮头股份	1,364,700	13,892,646.00	0.33
173	300721	怡达股份	1,091,140	13,890,212.20	0.33
174	603729	龙韵股份	863,100	13,887,279.00	0.33
175	300635	中达安	866,300	13,886,789.00	0.33
176	605186	健麾信息	706,400	13,880,760.00	0.33
177	301098	金埔园林	1,617,800	13,880,724.00	0.33
178	300883	龙利得	2,056,014	13,878,094.50	0.33
179	300254	仟源医药	1,371,300	13,877,556.00	0.33
180	603982	泉峰汽车	1,657,806	13,875,836.22	0.33
181	301166	优宁维	467,300	13,869,464.00	0.33
182	603329	上海雅仕	1,260,450	13,864,950.00	0.33
183	300387	富邦科技	1,629,100	13,863,641.00	0.33
184	603076	乐惠国际	591,300	13,860,072.00	0.33
185	603177	德创环保	1,244,900	13,855,737.00	0.33
186	002982	湘佳股份	1,008,140	13,851,843.60	0.33
187	600854	春兰股份	2,775,200	13,848,248.00	0.33
188	002753	永东股份	1,942,200	13,847,886.00	0.33
189	301167	建研设计	852,086	13,846,397.50	0.33
190	300621	维业股份	1,646,250	13,844,962.50	0.33
191	600148	长春一东	707,400	13,843,818.00	0.33
192	000605	渤海股份	2,062,000	13,836,020.00	0.33
193	600444	国机通用	754,600	13,831,818.00	0.33
194	300025	华星创业	2,400,400	13,826,304.00	0.33
195	001366	播恩集团	1,034,100	13,825,917.00	0.33
196	002802	洪汇新材	1,111,043	13,821,374.92	0.33
197	002760	凤形股份	636,600	13,820,586.00	0.33
198	688067	爱威科技	562,555	13,816,350.80	0.33
199	002700	万憬能源	2,059,000	13,815,890.00	0.33
200	300958	建工修复	1,112,700	13,808,607.00	0.33
201	603208	江山欧派	948,800	13,805,040.00	0.33
202	300886	华业香料	532,690	13,801,997.90	0.33
203	603188	亚邦股份	3,006,900	13,801,671.00	0.33
204	603908	牧高笛	590,980	13,799,383.00	0.33
205	688218	江苏北人	604,663	13,798,409.66	0.33
206	603089	正裕工业	1,088,596	13,792,511.32	0.33
207	301059	金三江	1,094,530	13,791,078.00	0.33
208	002234	民和股份	1,599,400	13,786,828.00	0.33
209	600448	华纺股份	4,374,600	13,779,990.00	0.33
210	603335	迪生力	2,446,400	13,773,232.00	0.33

211	603096	新经典	790,200	13,765,284.00	0.33
212	300583	赛托生物	1,005,200	13,761,188.00	0.33
213	002377	国创高新	4,809,100	13,754,026.00	0.33
214	603326	我乐家居	1,544,800	13,748,720.00	0.33
215	300929	华骐环保	1,278,900	13,748,175.00	0.33
216	300334	津膜科技	1,975,000	13,746,000.00	0.33
217	301130	西点药业	481,200	13,733,448.00	0.33
218	600533	栖霞建设	5,359,700	13,720,832.00	0.33
219	300642	透景生命	746,100	13,720,779.00	0.33
220	600561	江西长运	2,114,800	13,703,904.00	0.33
221	000702	正虹科技	2,050,000	13,694,000.00	0.33
222	603183	建研院	3,177,000	13,692,870.00	0.33
223	000637	茂化实华	3,184,109	13,691,668.70	0.33
224	002798	帝欧水华	2,388,200	13,684,386.00	0.33
225	002873	新天药业	1,378,100	13,670,752.00	0.33
226	001260	坤泰股份	678,100	13,643,372.00	0.33
227	688296	和达科技	1,029,514	13,641,060.50	0.33
228	688597	煜邦电力	1,659,932	13,628,041.72	0.33
229	301024	霍普股份	385,200	13,624,524.00	0.33
230	605567	春雪食品	1,238,300	13,621,300.00	0.33
231	300405	科隆股份	2,134,100	13,615,558.00	0.32
232	301185	鸥玛软件	712,200	13,603,020.00	0.32
233	300422	博世科	2,962,500	13,597,875.00	0.32
234	000548	湖南投资	2,498,700	13,592,928.00	0.32
235	688038	中科通达	769,101	13,590,014.67	0.32
236	301032	新柴股份	1,129,200	13,584,276.00	0.32
237	300030	阳普医疗	1,845,300	13,581,408.00	0.32
238	600371	万向德农	1,555,100	13,560,472.00	0.32
239	300966	共同药业	688,400	13,554,596.00	0.32
240	600159	大龙地产	4,892,800	13,553,056.00	0.32
241	600303	曙光股份	4,154,600	13,543,996.00	0.32
242	603779	威龙股份	2,102,200	13,538,168.00	0.32
243	000757	浩物股份	2,769,700	13,488,439.00	0.32
244	603818	曲美家居	3,734,700	13,482,267.00	0.32
245	002780	三夫户外	938,000	13,469,680.00	0.32
246	600833	第一医药	1,040,200	13,449,786.00	0.32
247	605177	东亚药业	755,430	13,446,654.00	0.32
248	000153	丰原药业	2,143,920	13,442,378.40	0.32
249	000790	华神科技	3,467,300	13,418,451.00	0.32
250	001219	青岛食品	939,278	13,384,711.50	0.32
251	603168	莎普爱思	1,814,300	13,353,248.00	0.32

252	600774	汉商集团	1,459,700	13,341,658.00	0.32
253	300534	陇神戎发	1,407,100	13,339,308.00	0.32
254	600791	京能置业	2,848,400	13,330,512.00	0.32
255	601996	丰林集团	5,900,200	13,275,450.00	0.32
256	002732	燕塘乳业	776,300	13,212,626.00	0.32
257	002495	佳隆股份	4,944,500	13,152,370.00	0.31
258	600692	亚通股份	1,852,600	12,986,726.00	0.31
259	301320	豪江智能	735,500	12,481,435.00	0.30
260	603137	恒尚节能	906,840	12,459,981.60	0.30
261	001378	德冠新材	508,300	11,985,714.00	0.29
262	605151	西上海	622,853	11,765,693.17	0.28
263	688229	博睿数据	187,414	11,747,109.52	0.28
264	688468	科美诊断	1,567,700	11,506,918.00	0.27
265	300786	国林科技	659,300	10,739,997.00	0.26
266	600689	上海三毛	791,500	10,637,760.00	0.25
267	688132	邦彦技术	568,867	10,478,530.14	0.25
268	301053	远信工业	291,800	10,300,540.00	0.25
269	300789	唐源电气	444,800	10,230,400.00	0.24
270	688551	科威尔	276,238	10,173,845.54	0.24
271	301203	国泰环保	307,200	10,027,008.00	0.24
272	688137	近岸蛋白	241,351	9,666,107.55	0.23
273	300930	屹通新材	318,600	9,462,420.00	0.23
274	688496	清越科技	1,576,150	9,362,331.00	0.22
275	603307	扬州金泉	238,100	9,359,711.00	0.22
276	688619	罗普特	667,994	9,084,718.40	0.22
277	688004	博汇科技	358,236	8,285,998.68	0.20
278	300796	贝斯美	910,900	7,915,721.00	0.19
279	688092	爱科科技	264,276	6,643,898.64	0.16
280	688529	豪森智能	344,320	6,349,260.80	0.15
281	688395	正弦电气	218,768	5,320,437.76	0.13
282	002909	集泰股份	707,200	4,816,032.00	0.11
283	688071	华依科技	131,548	4,363,447.16	0.10
284	688355	明志科技	244,851	4,358,347.80	0.10
285	301037	保立佳	291,100	4,191,840.00	0.10
286	301065	本立科技	190,500	4,067,175.00	0.10
287	300853	申昊科技	181,700	3,764,824.00	0.09
288	301006	迈拓股份	213,200	3,515,668.00	0.08
289	688638	誉辰智能	90,188	3,276,530.04	0.08
290	688026	洁特生物	185,233	2,984,103.63	0.07
291	688069	德林海	131,099	2,940,550.57	0.07
292	002591	恒大高新	344,201	2,794,912.12	0.07

293	688530	欧莱新材	157,246	2,585,124.24	0.06
294	301170	锡南科技	79,451	2,220,655.45	0.05
295	301081	严牌股份	213,352	2,161,255.76	0.05
296	603172	万丰股份	119,400	2,125,320.00	0.05
297	688329	艾隆科技	98,632	2,099,875.28	0.05
298	301515	港通医疗	95,294	1,911,597.64	0.05
299	301107	瑜欣电子	66,500	1,877,960.00	0.04
300	301520	万邦医药	46,990	1,866,912.70	0.04
301	301502	华阳智能	36,600	1,635,288.00	0.04
302	688616	西力科技	131,218	1,604,796.14	0.04
303	688659	元琛科技	162,680	1,537,326.00	0.04
304	688060	云涌科技	28,493	1,206,108.69	0.03
305	688795	摩尔线程	2,321	965,953.78	0.02
306	301290	东星医疗	35,500	897,085.00	0.02
307	301359	东南电子	33,000	630,960.00	0.02
308	301273	瑞晨环保	20,200	535,098.00	0.01
309	688450	光格科技	14,782	407,687.56	0.01
310	688802	沐曦股份	814	325,038.34	0.01
311	688056	莱伯泰科	8,995	302,321.95	0.01
312	688078	龙软科技	10,373	285,257.50	0.01
313	688783	西安奕材	14,790	271,544.40	0.01
314	002995	天地在线	16,400	270,928.00	0.01
315	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
316	688765	禾元生物	3,529	185,695.98	0.00
317	001333	光华股份	6,700	144,050.00	0.00
318	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
319	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
320	688759	必贝特	3,170	81,103.65	0.00
321	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.00
322	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
323	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
324	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
325	301678	新恒汇	382	24,532.04	0.00
326	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
327	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
328	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
329	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
330	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
331	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
332	001369	双欣材料	897	11,562.33	0.00
333	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00

334	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
335	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
336	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
337	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
338	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
339	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
340	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
341	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
342	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
343	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
344	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
345	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
346	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
347	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
348	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
349	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
350	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
351	603400	华之杰	57	2,980.53	0.00
352	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
353	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
354	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300103	达刚控股	59,910,265.00	11.95
2	688565	力源科技	58,572,753.39	11.68
3	688251	井松智能	58,340,201.02	11.64
4	603717	天域生物	57,730,530.00	11.52
5	688004	博汇科技	56,368,106.00	11.24
6	300845	捷安高科	55,632,722.18	11.10
7	603177	德创环保	54,695,866.00	10.91
8	600159	大龙地产	54,621,939.00	10.90
9	600444	国机通用	54,493,787.00	10.87
10	688067	爱威科技	53,002,642.19	10.57
11	301037	保立佳	52,388,269.42	10.45
12	301300	远翔新材	52,188,332.50	10.41
13	688455	科捷智能	52,058,080.19	10.38
14	002723	小崧股份	51,942,624.20	10.36

15	300854	中兰环保	51,896,165.00	10.35
16	300992	泰福泵业	51,336,997.67	10.24
17	301131	聚赛龙	51,249,849.18	10.22
18	603045	福达合金	51,021,972.80	10.18
19	301053	远信工业	49,809,078.62	9.94
20	301287	康力源	49,735,758.00	9.92
21	002830	名雕股份	49,685,218.91	9.91
22	300246	宝莱特	49,674,423.67	9.91
23	603637	镇海股份	49,551,806.75	9.88
24	688328	深科达	49,408,862.08	9.86
25	600697	欧亚集团	49,346,922.00	9.84
26	600137	浪莎股份	49,279,548.00	9.83
27	688573	信宇人	48,699,257.00	9.71
28	301163	宏德股份	48,589,747.08	9.69
29	300823	建科智能	48,560,686.40	9.69
30	300610	晨化股份	48,319,645.60	9.64
31	301515	港通医疗	48,295,327.08	9.63
32	300405	科隆股份	48,265,924.19	9.63
33	001260	坤泰股份	47,956,804.56	9.57
34	300614	百川畅银	47,810,616.00	9.54
35	605122	四方新材	47,784,129.00	9.53
36	603041	美思德	47,729,891.60	9.52
37	688021	奥福科技	47,617,724.58	9.50
38	688616	西力科技	47,600,444.37	9.49
39	688296	和达科技	46,901,881.58	9.36
40	003011	海象新材	46,872,879.90	9.35
41	688216	气派科技	46,681,382.93	9.31
42	688058	宝兰德	46,302,313.70	9.24
43	603321	梅轮电梯	46,299,566.00	9.24
44	603679	华体科技	46,273,967.00	9.23
45	301133	金钟股份	46,115,268.54	9.20
46	688078	龙软科技	46,104,212.62	9.20
47	688026	洁特生物	46,056,615.52	9.19
48	688659	元琛科技	45,862,649.64	9.15
49	300635	中达安	45,257,273.04	9.03
50	603810	丰山集团	44,469,315.80	8.87
51	301353	普莱得	44,401,645.68	8.86
52	300371	汇中股份	44,387,729.60	8.85
53	688681	科汇股份	44,348,877.40	8.85
54	301313	凡拓数创	44,264,837.00	8.83
55	300649	杭州园林	44,002,891.64	8.78

56	001366	播恩集团	43,920,087.00	8.76
57	605258	协和电子	43,822,000.00	8.74
58	688679	通源环境	43,680,867.98	8.71
59	001202	炬申股份	43,644,155.00	8.71
60	301314	科瑞思	43,525,807.70	8.68
61	688092	爱科科技	43,453,171.16	8.67
62	600847	万里股份	43,237,027.00	8.62
63	300509	新美星	43,104,785.21	8.60
64	300517	海波重科	43,064,621.30	8.59
65	688395	正弦电气	43,044,597.24	8.59
66	688329	艾隆科技	42,986,266.79	8.57
67	301469	恒达新材	42,931,902.40	8.56
68	301072	中捷精工	42,735,198.58	8.52
69	002921	联诚精密	42,699,121.24	8.52
70	300615	欣天科技	42,594,293.00	8.50
71	688613	奥精医疗	42,587,708.74	8.49
72	300417	南华仪器	42,426,959.05	8.46
73	300912	凯龙高科	42,414,004.35	8.46
74	002136	安纳达	42,406,851.00	8.46
75	603578	三星新材	42,272,134.84	8.43
76	605151	西上海	42,157,563.35	8.41
77	300658	延江股份	42,112,242.40	8.40
78	688272	富吉瑞	42,091,429.79	8.40
79	300564	筑博设计	41,884,585.59	8.35
80	300554	三超新材	41,832,760.00	8.34
81	001225	和泰机电	41,747,538.00	8.33
82	300670	大烨智能	41,646,379.00	8.31
83	002780	三夫户外	41,470,763.60	8.27
84	603335	迪生力	41,408,172.76	8.26
85	688485	九州一轨	41,356,919.18	8.25
86	688156	路德科技	41,311,351.45	8.24
87	300535	达威股份	41,273,572.12	8.23
88	603073	彩蝶实业	41,248,253.94	8.23
89	003027	同兴科技	41,225,002.85	8.22
90	603506	南都物业	40,985,744.08	8.18
91	688517	金冠电气	40,906,984.58	8.16
92	002295	精艺股份	40,819,096.00	8.14
93	603161	科华控股	40,779,367.18	8.13
94	301577	美信科技	40,660,250.00	8.11
95	301231	荣信文化	40,529,723.52	8.08
96	603102	百合股份	40,400,003.12	8.06

97	300837	浙矿股份	40,382,929.00	8.05
98	600561	江西长运	40,235,728.00	8.03
99	300668	杰恩设计	40,182,904.72	8.02
100	300626	华瑞股份	40,053,349.26	7.99
101	300749	顶固集创	40,048,639.92	7.99
102	003003	天元股份	40,009,091.88	7.98
103	300931	通用电梯	40,003,803.39	7.98
104	002591	恒大高新	40,000,166.88	7.98
105	301512	智信精密	39,963,233.74	7.97
106	688597	煜邦电力	39,891,621.62	7.96
107	301065	本立科技	39,785,415.84	7.94
108	603709	中源家居	39,643,957.83	7.91
109	301045	天禄科技	39,604,988.35	7.90
110	000619	海螺新材	39,478,072.00	7.87
111	300556	丝路视觉	39,389,685.00	7.86
112	002144	宏达高科	39,369,718.35	7.85
113	301159	三维天地	39,342,338.00	7.85
114	605180	华生科技	39,273,338.13	7.83
115	301295	美硕科技	39,167,716.52	7.81
116	301197	工大科雅	39,156,253.80	7.81
117	300334	津膜科技	39,133,571.00	7.81
118	001219	青岛食品	39,018,380.88	7.78
119	603331	百达精工	39,017,540.70	7.78
120	002890	弘宇股份	39,013,392.88	7.78
121	603139	康惠股份	38,856,420.00	7.75
122	301118	恒光股份	38,834,748.37	7.75
123	000757	浩物股份	38,821,595.00	7.74
124	002998	优彩资源	38,777,252.68	7.73
125	002809	红墙股份	38,771,947.87	7.73
126	688056	莱伯泰科	38,755,377.73	7.73
127	600051	宁波联合	38,649,301.74	7.71
128	002817	黄山胶囊	38,441,913.46	7.67
129	605155	西大门	38,431,723.80	7.67
130	002858	力盛体育	38,067,686.00	7.59
131	688229	博睿数据	38,028,580.41	7.59
132	603137	恒尚节能	37,835,409.00	7.55
133	300621	维业股份	37,756,414.50	7.53
134	300883	龙利得	37,693,300.01	7.52
135	002887	绿茵生态	37,690,617.10	7.52
136	605177	东亚药业	37,647,855.43	7.51
137	300305	裕兴股份	37,633,401.56	7.51

138	301555	惠柏新材	37,576,557.03	7.50
139	001231	农心科技	37,521,081.00	7.48
140	688045	必易微	37,396,766.48	7.46
141	688619	罗普特	37,307,276.08	7.44
142	301125	腾亚精工	37,298,528.88	7.44
143	603017	中衡设计	37,296,385.00	7.44
144	603329	上海雅仕	37,209,755.10	7.42
145	300838	浙江力诺	37,007,180.72	7.38
146	603860	中公高科	36,991,911.02	7.38
147	002753	永东股份	36,938,428.00	7.37
148	688022	瀚川智能	36,845,379.32	7.35
149	301198	喜悦智行	36,806,395.14	7.34
150	605189	富春染织	36,747,367.15	7.33
151	301519	舜禹股份	36,743,952.00	7.33
152	600097	开创国际	36,715,170.18	7.32
153	603188	亚邦股份	36,646,828.00	7.31
154	600791	京能置业	36,597,592.00	7.30
155	300549	优德精密	36,474,604.00	7.28
156	002968	新大正	36,380,806.00	7.26
157	301043	绿岛风	36,318,471.00	7.24
158	000955	欣龙控股	36,129,762.00	7.21
159	002114	罗平锌电	36,104,268.19	7.20
160	001228	永泰运	36,063,014.56	7.19
161	688309	恒誉环保	35,875,553.48	7.16
162	301290	东星医疗	35,775,944.00	7.14
163	600232	金鹰股份	35,752,564.00	7.13
164	000637	茂化实华	35,703,037.31	7.12
165	000790	华神科技	35,682,964.27	7.12
166	300640	德艺文创	35,677,638.60	7.12
167	688693	锴威特	35,672,460.09	7.12
168	603022	新通联	35,631,581.00	7.11
169	688695	中创股份	35,577,591.62	7.10
170	301075	多瑞医药	35,491,728.00	7.08
171	301006	迈拓股份	35,346,690.20	7.05
172	301167	建研设计	35,344,174.34	7.05
173	603536	惠发食品	35,300,202.60	7.04
174	603326	我乐家居	35,236,754.00	7.03
175	002798	帝欧水华	35,063,579.47	6.99
176	301429	森泰股份	34,893,552.20	6.96
177	301390	经纬股份	34,885,998.00	6.96
178	301355	南王科技	34,816,932.84	6.94

179	300637	扬帆新材	34,814,583.12	6.94
180	301040	中环海陆	34,776,418.87	6.94
181	002494	华斯股份	34,729,472.00	6.93
182	688737	中自科技	34,631,223.75	6.91
183	002105	信隆健康	34,540,084.93	6.89
184	002909	集泰股份	34,530,357.41	6.89
185	301148	嘉戎技术	34,457,168.20	6.87
186	603028	赛福天	34,422,470.90	6.87
187	688038	中科通达	34,415,372.84	6.86
188	301130	西点药业	34,414,303.44	6.86
189	002873	新天药业	34,227,313.79	6.83
190	001209	洪兴股份	34,062,479.80	6.79
191	002949	华阳国际	34,038,677.00	6.79
192	002715	登云股份	33,997,421.96	6.78
193	688355	明志科技	33,881,347.79	6.76
194	605567	春雪食品	33,860,608.81	6.75
195	300971	博亚精工	33,846,622.48	6.75
196	300935	盈建科	33,832,554.82	6.75
197	000548	湖南投资	33,810,129.29	6.74
198	600689	上海三毛	33,798,652.00	6.74
199	603968	醋化股份	33,756,419.00	6.73
200	688551	科威尔	33,738,542.96	6.73
201	688793	倍轻松	33,705,364.23	6.72
202	688671	碧兴物联	33,675,116.17	6.72
203	603289	泰瑞机器	33,560,795.50	6.69
204	301336	趣睡科技	33,551,511.45	6.69
205	603908	牧高笛	33,520,513.80	6.69
206	603378	亚士创能	33,516,310.68	6.69
207	300500	启迪设计	33,496,194.72	6.68
208	600833	第一医药	33,467,082.76	6.68
209	300929	华骐环保	33,448,460.60	6.67
210	603208	江山欧派	33,442,941.60	6.67
211	001218	丽臣实业	33,438,330.68	6.67
212	301273	瑞晨环保	33,243,258.00	6.63
213	301272	英华特	33,226,934.73	6.63
214	002696	百洋股份	33,207,391.85	6.62
215	300030	阳普医疗	33,087,600.00	6.60
216	601996	丰林集团	33,081,588.00	6.60
217	000985	大庆华科	33,068,634.20	6.60
218	001259	利仁科技	33,016,601.56	6.59
219	301059	金三江	32,903,780.10	6.56

220	688450	光格科技	32,862,230.34	6.55
221	600356	恒丰纸业	32,825,009.85	6.55
222	300717	华信新材	32,809,050.00	6.54
223	300675	建科院	32,775,420.00	6.54
224	600706	曲江文旅	32,773,948.40	6.54
225	603182	嘉华股份	32,763,336.95	6.54
226	300955	嘉亨家化	32,573,550.00	6.50
227	001210	金房能源	32,537,316.01	6.49
228	603778	国晟科技	32,505,799.00	6.48
229	300141	和顺电气	32,431,465.50	6.47
230	003008	开普检测	32,386,720.70	6.46
231	002883	中设股份	32,120,609.11	6.41
232	002133	广宇集团	32,091,886.00	6.40
233	300886	华业香料	32,047,063.30	6.39
234	688203	海正生材	32,041,904.57	6.39
235	002857	三晖电气	31,983,545.20	6.38
236	603725	天安新材	31,883,638.60	6.36
237	600235	民丰特纸	31,805,206.00	6.34
238	001387	雪祺电气	31,802,501.08	6.34
239	301218	华是科技	31,799,286.50	6.34
240	600303	曙光股份	31,788,977.00	6.34
241	688448	磁谷科技	31,742,401.64	6.33
242	301505	苏州规划	31,729,148.34	6.33
243	300597	吉大通信	31,719,307.84	6.33
244	002679	福建金森	31,677,474.52	6.32
245	003030	祖名股份	31,621,071.00	6.31
246	002576	通达动力	31,568,065.00	6.30
247	600692	亚通股份	31,467,823.00	6.28
248	301097	天益医疗	31,427,110.20	6.27
249	001211	双枪科技	31,400,261.01	6.26
250	688638	誉辰智能	31,364,468.39	6.26
251	300519	新光药业	31,357,494.48	6.25
252	603172	万丰股份	31,125,766.91	6.21
253	600371	万向德农	31,101,747.90	6.20
254	001278	一彬科技	30,996,362.58	6.18
255	688618	三旺通信	30,807,833.88	6.15
256	300721	怡达股份	30,799,447.00	6.14
257	002760	凤形股份	30,755,746.00	6.13
258	300970	华绿生物	30,701,938.52	6.12
259	605287	德才股份	30,632,121.68	6.11
260	001255	博菲电气	30,630,985.00	6.11

261	600493	凤竹纺织	30,418,783.14	6.07
262	300422	博世科	30,376,900.00	6.06
263	301063	海锅股份	30,304,453.70	6.04
264	603488	展鹏科技	30,275,495.00	6.04
265	300958	建工修复	30,153,897.00	6.01
266	002012	凯恩股份	30,114,245.99	6.01
267	001373	翔腾新材	30,097,981.95	6.00
268	003042	中农联合	30,093,424.40	6.00
269	688218	江苏北人	29,856,460.81	5.96
270	002691	冀凯股份	29,797,914.50	5.94
271	600785	新华百货	29,791,352.00	5.94
272	603356	华菱精工	29,734,552.00	5.93
273	300707	威唐工业	29,655,399.99	5.92
274	301010	晶雪节能	29,643,079.00	5.91
275	002775	文科股份	29,619,520.80	5.91
276	301126	达嘉维康	29,585,859.72	5.90
277	300780	德恩精工	29,459,981.00	5.88
278	688260	昀冢科技	29,378,295.41	5.86
279	301233	盛帮股份	29,350,449.00	5.85
280	301359	东南电子	29,308,659.40	5.85
281	603320	迪贝电气	29,298,650.30	5.84
282	002397	梦洁股份	29,208,846.00	5.83
283	301098	金埔园林	29,157,948.13	5.82
284	603353	和顺石油	29,125,057.40	5.81
285	301298	东利机械	29,092,078.00	5.80
286	003017	大洋生物	29,050,458.20	5.79
287	301203	国泰环保	29,037,599.55	5.79
288	688118	普元信息	28,961,277.74	5.78
289	300665	飞鹿股份	28,906,638.89	5.77
290	002718	友邦吊顶	28,897,435.90	5.76
291	688193	仁度生物	28,846,170.71	5.75
292	301502	华阳智能	28,672,930.00	5.72
293	605033	美邦股份	28,656,892.00	5.72
294	603029	天鹅股份	28,642,534.10	5.71
295	600408	安泰集团	28,537,784.00	5.69
296	603729	龙韵股份	28,501,052.00	5.68
297	300732	设研院	28,397,134.49	5.66
298	603048	浙江黎明	28,315,107.00	5.65
299	002702	海欣食品	28,312,895.38	5.65
300	002671	龙泉股份	28,211,127.23	5.63
301	600448	华纺股份	28,188,131.00	5.62

302	603311	金海高科	28,104,115.00	5.61
303	301049	超越科技	28,096,996.08	5.60
304	300606	金太阳	28,095,832.00	5.60
305	603458	勘设股份	28,040,191.42	5.59
306	300923	研奥股份	27,984,109.04	5.58
307	002856	美芝股份	27,651,568.50	5.52
308	002828	贝肯能源	27,617,346.00	5.51
309	603385	惠达卫浴	27,584,021.20	5.50
310	603080	新疆火炬	27,426,243.00	5.47
311	002871	伟隆股份	27,412,969.02	5.47
312	688013	天臣医疗	27,317,069.02	5.45
313	688113	联测科技	27,212,305.30	5.43
314	688530	欧莱新材	26,999,350.42	5.39
315	600615	鑫源智造	26,938,230.60	5.37
316	603282	亚光股份	26,929,137.00	5.37
317	688215	瑞晟智能	26,721,526.51	5.33
318	300966	共同药业	26,451,499.38	5.28
319	300948	冠中生态	26,431,612.00	5.27
320	301360	荣旗科技	26,369,473.00	5.26
321	002799	环球印务	26,333,263.81	5.25
322	002778	中晟高科	26,280,883.00	5.24
323	300605	恒锋信息	26,269,322.00	5.24
324	300786	国林科技	26,257,491.00	5.24
325	301446	福事特	26,236,177.94	5.23
326	301156	美农生物	26,231,605.76	5.23
327	301234	五洲医疗	26,175,504.00	5.22
328	603836	海程邦达	26,052,071.97	5.20
329	603183	建研院	26,048,845.93	5.20
330	600883	博闻科技	25,953,863.24	5.18
331	300385	雪浪环境	25,899,261.20	5.17
332	688466	金科环境	25,888,078.03	5.16
333	301232	飞沃科技	25,749,639.40	5.14
334	002802	洪汇新材	25,744,085.91	5.14
335	600539	狮头股份	25,716,785.00	5.13
336	603700	宁水集团	25,666,920.14	5.12
337	603176	汇通集团	25,660,095.00	5.12
338	301001	凯淳股份	25,637,889.00	5.11
339	688096	京源环保	25,595,865.21	5.11
340	603685	晨丰科技	25,581,581.00	5.10
341	600802	福建水泥	25,535,846.16	5.09
342	603880	南卫股份	25,523,319.80	5.09

343	600099	林海股份	25,424,259.00	5.07
344	603779	威龙股份	25,416,526.50	5.07
345	600774	汉商集团	25,373,757.00	5.06
346	301192	泰祥股份	25,363,359.40	5.06
347	600128	苏豪弘业	25,354,071.00	5.06
348	002763	汇洁股份	25,330,115.80	5.05
349	300155	安居宝	25,323,883.99	5.05
350	300254	仟源医药	25,309,832.00	5.05
351	688651	盛邦安全	25,286,987.10	5.04
352	002853	皮阿诺	25,279,347.03	5.04
353	603982	泉峰汽车	25,217,016.81	5.03
354	605003	众望布艺	25,136,240.50	5.01
355	002687	乔治白	25,127,148.40	5.01
356	301002	崧盛股份	24,972,607.00	4.98
357	603696	安记食品	24,916,334.40	4.97
358	300176	鸿特科技	24,903,652.00	4.97
359	002719	麦趣尔	24,809,929.00	4.95
360	002999	天禾股份	24,770,666.80	4.94
361	300585	奥联电子	24,745,190.00	4.94
362	688393	安必平	24,730,254.51	4.93
363	688163	赛伦生物	24,644,472.73	4.92
364	603819	神力股份	24,622,083.00	4.91
365	300538	同益股份	24,618,994.32	4.91
366	300647	超频三	24,550,332.00	4.90
367	301111	粤万年青	24,537,960.06	4.89
368	000573	粤宏远 A	24,527,065.00	4.89
369	301185	鸥玛软件	24,415,008.00	4.87
370	688426	康为世纪	24,407,860.38	4.87
371	300828	锐新科技	24,350,258.50	4.86
372	300387	富邦科技	24,349,048.66	4.86
373	300612	宣亚国际	24,331,976.15	4.85
374	300642	透景生命	24,299,475.60	4.85
375	603332	苏州龙杰	24,296,759.58	4.85
376	301166	优宁维	24,295,902.00	4.85
377	300514	友讯达	24,280,650.00	4.84
378	600854	春兰股份	24,266,348.95	4.84
379	300906	日月明	24,235,290.00	4.83
380	000605	渤海股份	24,196,254.80	4.83
381	001234	泰慕士	24,161,913.00	4.82
382	300335	迪森股份	24,156,827.82	4.82
383	300907	康平科技	24,129,837.09	4.81

384	301276	嘉曼服饰	24,125,744.34	4.81
385	300243	瑞丰高材	24,084,813.60	4.80
386	605336	帅丰电器	24,083,976.30	4.80
387	002381	双箭股份	24,040,413.00	4.80
388	300270	中威电子	24,008,210.38	4.79
389	300112	万讯自控	24,002,400.00	4.79
390	002566	益盛药业	23,914,662.50	4.77
391	300074	华平股份	23,889,379.00	4.77
392	002806	华锋股份	23,850,710.89	4.76
393	603096	新经典	23,674,973.00	4.72
394	002910	庄园牧场	23,599,301.00	4.71
395	002209	达意隆	23,570,882.75	4.70
396	603307	扬州金泉	23,506,914.12	4.69
397	002836	新宏泽	23,498,298.74	4.69
398	300694	蠡湖股份	23,433,374.00	4.67
399	301418	协昌科技	23,393,030.00	4.67
400	300321	同大股份	23,381,382.00	4.66
401	300804	广康生化	23,368,367.00	4.66
402	300813	泰林生物	23,363,968.84	4.66
403	002800	天顺股份	23,363,304.80	4.66
404	001226	拓山重工	23,342,454.00	4.66
405	002732	燕塘乳业	23,274,563.38	4.64
406	300800	力合科技	23,181,070.00	4.62
407	301170	锡南科技	23,180,761.23	4.62
408	301113	雅艺科技	23,179,727.83	4.62
409	301081	严牌股份	23,104,042.56	4.61
410	600257	大湖股份	23,042,829.99	4.60
411	300928	华安鑫创	23,006,461.98	4.59
412	300710	万隆光电	22,979,303.11	4.58
413	301041	金百泽	22,883,067.00	4.56
414	688607	康众医疗	22,798,540.63	4.55
415	603937	丽岛新材	22,787,521.00	4.55
416	688367	工大高科	22,734,584.95	4.53
417	600665	天地源	22,655,199.00	4.52
418	605303	园林股份	22,622,697.00	4.51
419	000632	三木集团	22,615,399.99	4.51
420	600156	华升股份	22,612,595.00	4.51
421	300686	智动力	22,525,704.00	4.49
422	002420	毅昌科技	22,523,612.00	4.49
423	300412	迦南科技	22,514,650.90	4.49
424	000593	德龙汇能	22,472,912.90	4.48

425	301057	汇隆新材	22,392,461.00	4.47
426	688345	博力威	22,217,924.63	4.43
427	000702	正虹科技	22,181,762.00	4.42
428	301158	德石股份	22,151,646.00	4.42
429	603042	华脉科技	22,059,816.52	4.40
430	688528	秦川物联	21,652,998.69	4.32
431	300977	深圳瑞捷	21,607,456.37	4.31
432	301235	华康洁净	21,513,532.50	4.29
433	603917	合力科技	21,492,276.40	4.29
434	603909	建发合诚	21,378,439.00	4.26
435	001368	通达创智	21,348,395.09	4.26
436	002963	豪尔赛	21,314,106.00	4.25
437	603682	锦和商管	21,307,064.00	4.25
438	300295	三六五网	20,842,313.50	4.16
439	002524	光正眼科	20,795,690.00	4.15
440	688175	高凌信息	20,722,670.97	4.13
441	603190	亚通精工	20,663,212.02	4.12
442	300865	大宏立	20,447,027.06	4.08
443	300937	药易购	20,427,729.00	4.07
444	600533	栖霞建设	20,284,189.00	4.05
445	002820	桂发祥	20,243,170.00	4.04
446	603903	中持股份	20,235,459.92	4.04
447	300645	正元智慧	20,192,191.80	4.03
448	603818	曲美家居	20,188,139.00	4.03
449	300876	蒙泰高新	20,144,916.00	4.02
450	600969	郴电国际	20,125,516.00	4.01
451	300807	天迈科技	20,117,963.00	4.01
452	688350	富淼科技	20,065,382.50	4.00
453	002084	海鸥住工	20,060,963.32	4.00
454	300778	新城市	19,894,956.38	3.97
455	301022	海泰科	19,879,899.20	3.97
456	002787	华源控股	19,859,649.53	3.96
457	301378	通达海	19,846,873.40	3.96
458	003023	彩虹集团	19,821,455.40	3.95
459	300464	星徽股份	19,807,824.00	3.95
460	600719	大连热电	19,601,236.98	3.91
461	300851	交大思诺	19,566,487.00	3.90
462	301042	安联锐视	19,545,240.00	3.90
463	301588	美新科技	19,538,693.29	3.90
464	301105	鸿铭股份	19,504,765.00	3.89
465	688148	芳源股份	19,422,144.60	3.87

466	688420	美腾科技	19,383,051.29	3.87
467	002682	龙洲股份	19,328,625.10	3.86
468	002743	富煌钢构	19,212,412.00	3.83
469	301019	宁波色母	19,179,552.14	3.83
470	001336	楚环科技	19,029,082.24	3.80
471	600540	新赛股份	19,012,785.00	3.79
472	001333	光华股份	18,973,647.00	3.78
473	001215	千味央厨	18,780,745.00	3.75
474	688237	超卓航科	18,697,885.66	3.73
475	300713	英可瑞	18,663,557.00	3.72
476	001230	劲旅环境	18,586,564.80	3.71
477	688335	复洁科技	18,577,080.97	3.71
478	605255	天普股份	18,457,658.00	3.68
479	002795	永和智控	18,363,311.84	3.66
480	603122	合富中国	18,326,589.00	3.66
481	603272	联翔股份	17,951,939.00	3.58
482	688655	迅捷兴	17,861,449.92	3.56
483	688069	德林海	17,792,234.68	3.55
484	300816	艾可蓝	17,729,064.00	3.54
485	688669	聚石化学	17,257,831.03	3.44
486	301237	和顺科技	17,007,558.00	3.39
487	603755	日辰股份	16,977,559.89	3.39
488	688288	鸿泉技术	16,939,731.72	3.38
489	688189	南新制药	16,792,927.20	3.35
490	603214	爱婴室	16,628,268.00	3.32
491	001326	联域股份	16,621,361.00	3.32
492	002492	恒基达鑫	16,599,988.50	3.31
493	688109	品茗科技	16,483,639.81	3.29
494	300575	中旗股份	16,483,031.00	3.29
495	301107	瑜欣电子	16,476,604.00	3.29
496	603059	倍加洁	16,340,312.00	3.26
497	688081	兴图新科	16,199,334.17	3.23
498	300086	康芝药业	16,182,715.00	3.23
499	603089	正裕工业	16,150,710.56	3.22
500	688338	赛科希德	16,098,095.85	3.21
501	002571	德力股份	16,008,907.84	3.19
502	300692	中赋科技	15,989,876.00	3.19
503	300599	雄塑科技	15,950,796.00	3.18
504	001266	宏英智能	15,903,911.60	3.17
505	300449	汉邦高科	15,893,607.00	3.17
506	301222	浙江恒威	15,873,318.00	3.17

507	002893	京能热力	15,844,655.30	3.16
508	002861	瀛通通讯	15,809,215.00	3.15
509	301115	联检科技	15,784,612.00	3.15
510	688171	纬德信息	15,736,574.43	3.14
511	605001	威奥股份	15,612,793.30	3.11
512	300240	飞力达	15,608,618.00	3.11
513	301337	亚华电子	15,567,263.00	3.11
514	603829	洛凯股份	15,475,528.56	3.09
515	002066	瑞泰科技	15,457,194.00	3.08
516	603617	君禾股份	15,285,698.00	3.05
517	301448	开创电气	15,265,682.70	3.04
518	301257	普蕊斯	15,261,911.00	3.04
519	603076	乐惠国际	15,222,819.11	3.04
520	000635	英力特	15,221,098.50	3.04
521	301135	瑞德智能	15,195,396.75	3.03
522	002982	湘佳股份	15,167,756.48	3.03
523	301027	华蓝集团	15,125,129.00	3.02
524	300583	赛托生物	15,102,996.85	3.01
525	300987	川网传媒	15,033,033.00	3.00
526	002377	国创高新	15,009,101.00	2.99
527	300849	锦盛新材	14,980,880.20	2.99
528	301122	采纳股份	14,966,596.80	2.99
529	300936	中英科技	14,940,881.00	2.98
530	688307	中润光学	14,932,381.60	2.98
531	603168	莎普爱思	14,902,543.22	2.97
532	300025	华星创业	14,880,330.00	2.97
533	300746	汉嘉数智	14,870,498.30	2.97
534	603090	宏盛股份	14,853,229.00	2.96
535	603768	常青股份	14,850,481.00	2.96
536	688369	致远互联	14,779,777.45	2.95
537	600148	长春一东	14,776,817.00	2.95
538	002767	先锋电子	14,738,914.00	2.94
539	300594	朗进科技	14,699,019.00	2.93
540	605186	健麾信息	14,651,297.84	2.92
541	688170	德龙激光	14,619,342.44	2.92
542	300242	佳云科技	14,602,574.00	2.91
543	300501	海顺新材	14,567,482.00	2.91
544	301032	新柴股份	14,467,801.00	2.89
545	000153	丰原药业	14,449,986.60	2.88
546	001324	长青科技	14,414,805.00	2.88
547	301106	骏成科技	14,403,067.80	2.87

548	002700	万憬能源	14,392,966.00	2.87
549	000590	古汉医药	14,352,934.75	2.86
550	300534	陇神戎发	14,351,750.00	2.86
551	688323	瑞华泰	14,343,295.59	2.86
552	002495	佳隆股份	14,320,678.00	2.86
553	603051	鹿山新材	14,310,337.15	2.85
554	002234	民和股份	14,307,763.00	2.85
555	603900	莱绅通灵	14,279,240.00	2.85
556	000159	国际实业	14,244,074.00	2.84
557	603318	水发燃气	14,170,377.00	2.83
558	300461	田中精机	14,088,658.00	2.81
559	605069	正和生态	14,077,918.00	2.81
560	300743	天地数码	13,955,262.76	2.78
561	300826	测绘股份	13,944,864.40	2.78
562	300730	科创信息	13,916,697.50	2.78
563	603787	新日股份	13,756,133.00	2.74
564	600337	美克家居	13,673,426.00	2.73
565	688060	云涌科技	13,613,554.59	2.72
566	688310	迈得医疗	13,591,776.62	2.71
567	301024	霍普股份	13,499,712.85	2.69
568	300947	德必集团	13,485,063.00	2.69
569	001299	美能能源	13,471,169.30	2.69
570	688121	卓然股份	13,192,043.57	2.63
571	603136	天目湖	13,114,204.00	2.62
572	002942	新农股份	12,890,352.00	2.57
573	301108	洁雅股份	12,829,438.54	2.56
574	002574	明牌珠宝	12,745,235.00	2.54
575	688098	申联生物	12,744,289.09	2.54
576	601007	金陵饭店	12,600,361.00	2.51
577	688560	明冠新材	12,582,042.92	2.51
578	300565	科信技术	12,552,992.00	2.50
579	301321	翰博高新	12,478,674.00	2.49
580	301320	豪江智能	12,402,020.00	2.47
581	688468	科美诊断	12,337,783.05	2.46
582	300329	海伦钢琴	12,327,417.00	2.46
583	301520	万邦医药	12,284,618.60	2.45
584	300562	乐心医疗	12,220,776.00	2.44
585	600573	惠泉啤酒	12,207,508.00	2.43
586	603926	铁流股份	12,141,701.10	2.42
587	301056	森赫股份	11,898,908.92	2.37
588	688132	邦彦技术	11,882,338.19	2.37

589	688479	友车科技	11,866,663.26	2.37
590	603221	爱丽家居	11,813,986.00	2.36
591	603839	安正时尚	11,687,172.00	2.33
592	001378	德冠新材	11,661,907.00	2.33
593	002205	国统股份	11,579,218.96	2.31
594	688496	清越科技	11,549,188.27	2.30
595	300591	万里马	11,506,581.50	2.30
596	688291	金橙子	11,440,876.60	2.28
597	002842	翔鹭钨业	11,406,744.73	2.28
598	688011	新光光电	11,273,243.88	2.25
599	300839	博汇股份	11,270,957.34	2.25
600	300930	屹通新材	11,139,539.00	2.22
601	688129	东来技术	11,103,117.78	2.21
602	002712	思美传媒	10,986,191.00	2.19
603	300651	金陵体育	10,846,138.00	2.16
604	301578	辰奕智能	10,566,198.68	2.11
605	301388	欣灵电气	10,532,415.00	2.10
606	301079	邵阳液压	10,516,004.00	2.10
607	603895	天永智能	10,488,054.00	2.09
608	301539	宏鑫科技	10,381,847.00	2.07
609	300560	中富通	10,327,586.00	2.06
610	300427	红相股份	10,320,295.00	2.06
611	301030	仕净科技	10,313,852.00	2.06
612	300771	智莱科技	10,295,610.00	2.05
613	002451	摩恩电气	10,281,633.00	2.05
614	301279	金道科技	10,222,258.30	2.04
615	000798	中水渔业	10,218,294.00	2.04
616	688137	近岸蛋白	10,072,175.79	2.01

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。

8.4.2 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	688251	井松智能	65,715,935.67	13.11
2	002830	名雕股份	61,405,907.72	12.25
3	301300	远翔新材	57,748,999.02	11.52
4	002723	小崧股份	56,224,475.40	11.21
5	688004	博汇科技	56,008,293.42	11.17
6	603177	德创环保	55,183,322.50	11.01
7	301037	保立佳	52,894,762.72	10.55
8	600697	欧亚集团	52,643,168.00	10.50

9	003011	海象新材	52,536,792.60	10.48
10	002295	精艺股份	52,430,988.00	10.46
11	688328	深科达	52,149,659.59	10.40
12	300658	延江股份	51,825,509.50	10.34
13	600137	浪莎股份	51,714,507.34	10.32
14	688679	通源环境	50,226,649.12	10.02
15	605122	四方新材	49,937,544.38	9.96
16	300103	达刚控股	49,899,754.96	9.95
17	688613	奥精医疗	49,723,835.75	9.92
18	603679	华体科技	49,348,873.00	9.84
19	300614	百川畅银	49,061,056.00	9.79
20	301515	港通医疗	48,602,850.32	9.69
21	300931	通用电梯	48,466,291.48	9.67
22	300845	捷安高科	48,354,648.80	9.65
23	300517	海波重科	48,313,293.50	9.64
24	300509	新美星	48,224,326.70	9.62
25	300749	顶固集创	48,157,166.60	9.61
26	688058	宝兰德	48,111,180.72	9.60
27	301133	金钟股份	48,092,828.82	9.59
28	301231	荣信文化	47,966,671.08	9.57
29	301053	远信工业	47,898,098.95	9.55
30	688565	力源科技	47,334,462.51	9.44
31	688616	西力科技	47,197,646.88	9.41
32	603717	天域生物	46,907,661.00	9.36
33	300670	大烨智能	46,824,866.82	9.34
34	603709	中源家居	46,775,682.54	9.33
35	600232	金鹰股份	46,635,441.72	9.30
36	300948	冠中生态	46,626,428.41	9.30
37	688659	元琛科技	46,530,796.10	9.28
38	300626	华瑞股份	45,948,861.08	9.17
39	688026	洁特生物	45,927,861.39	9.16
40	688078	龙软科技	45,623,984.33	9.10
41	603506	南都物业	45,379,959.77	9.05
42	003027	同兴科技	45,321,937.94	9.04
43	600444	国机通用	45,120,305.99	9.00
44	301469	恒达新材	44,970,660.00	8.97
45	688272	富吉瑞	44,852,252.41	8.95
46	605189	富春染织	44,530,612.56	8.88
47	001225	和泰机电	44,353,235.00	8.85
48	603139	康惠股份	44,323,537.00	8.84
49	301118	恒光股份	43,940,217.73	8.76

50	605155	西大门	43,916,811.86	8.76
51	301040	中环海陆	43,852,293.00	8.75
52	301075	多瑞医药	43,714,097.00	8.72
53	688067	爱威科技	43,657,242.45	8.71
54	301159	三维天地	43,473,761.85	8.67
55	300837	浙矿股份	43,161,981.00	8.61
56	600159	大龙地产	43,118,574.21	8.60
57	600097	开创国际	42,972,024.83	8.57
58	300668	杰恩设计	42,888,047.93	8.55
59	002817	黄山胶囊	42,538,331.08	8.48
60	002591	恒大高新	42,390,391.90	8.46
61	603022	新通联	42,267,572.00	8.43
62	300854	中兰环保	42,264,644.00	8.43
63	603045	福达合金	42,191,012.30	8.42
64	301295	美硕科技	42,117,460.40	8.40
65	000955	欣龙控股	42,055,162.00	8.39
66	688329	艾隆科技	41,910,646.57	8.36
67	300500	启迪设计	41,683,081.70	8.31
68	301043	绿岛风	41,664,017.00	8.31
69	688156	路德科技	41,456,733.59	8.27
70	301577	美信科技	41,391,826.00	8.26
71	301287	康力源	41,337,291.11	8.25
72	002858	力盛体育	40,498,856.18	8.08
73	301429	森泰股份	39,827,097.07	7.94
74	002968	新大正	39,747,163.30	7.93
75	603017	中衡设计	39,579,125.00	7.89
76	300640	德艺文创	39,559,018.00	7.89
77	688455	科捷智能	39,387,998.87	7.86
78	688395	正弦电气	39,262,076.29	7.83
79	301125	腾亚精工	39,204,003.64	7.82
80	002114	罗平锌电	39,120,310.04	7.80
81	688693	锴威特	38,733,779.98	7.73
82	300935	盈建科	38,731,086.20	7.73
83	688737	中自科技	38,713,768.09	7.72
84	688056	莱伯泰科	38,688,992.98	7.72
85	300992	泰福泵业	38,558,733.00	7.69
86	002696	百洋股份	38,524,806.24	7.68
87	300246	宝莱特	38,484,935.06	7.68
88	603778	国晟科技	38,459,367.60	7.67
89	300955	嘉亨家化	38,370,775.93	7.65
90	301065	本立科技	38,255,884.50	7.63

91	688092	爱科科技	38,090,032.96	7.60
92	002715	登云股份	38,038,131.50	7.59
93	300823	建科智能	38,036,326.20	7.59
94	603536	惠发食品	38,035,392.40	7.59
95	301355	南王科技	37,928,378.00	7.57
96	688573	信宇人	37,627,369.73	7.51
97	301131	聚赛龙	37,587,016.00	7.50
98	002679	福建金森	37,548,446.20	7.49
99	300405	科隆股份	37,461,774.11	7.47
100	002691	冀凯股份	37,296,473.00	7.44
101	002105	信隆健康	37,269,652.04	7.43
102	301148	嘉戎技术	36,989,812.66	7.38
103	002883	中设股份	36,677,666.00	7.32
104	003030	祖名股份	36,620,612.00	7.30
105	002494	华斯股份	36,596,311.51	7.30
106	301163	宏德股份	36,490,288.27	7.28
107	301273	瑞晨环保	36,412,733.86	7.26
108	001202	炬申股份	36,372,760.52	7.26
109	300635	中达安	36,303,615.86	7.24
110	301336	趣睡科技	36,272,124.00	7.23
111	688695	中创股份	36,164,754.32	7.21
112	001210	金房能源	36,052,549.41	7.19
113	600493	凤竹纺织	36,000,862.53	7.18
114	300970	华绿生物	35,876,856.70	7.16
115	600706	曲江文旅	35,866,594.80	7.15
116	300141	和顺电气	35,821,530.53	7.15
117	001260	坤泰股份	35,804,854.00	7.14
118	003008	开普检测	35,731,653.50	7.13
119	603637	镇海股份	35,669,214.45	7.11
120	300371	汇中股份	35,570,554.53	7.10
121	301006	迈拓股份	35,539,847.86	7.09
122	301290	东星医疗	35,511,999.00	7.08
123	688671	碧兴物联	35,402,374.05	7.06
124	603041	美思德	35,323,843.80	7.05
125	603458	勘设股份	35,313,661.20	7.04
126	300912	凯龙高科	35,148,155.90	7.01
127	001366	播恩集团	35,041,873.28	6.99
128	001259	利仁科技	35,007,439.05	6.98
129	600847	万里股份	35,006,881.08	6.98
130	688021	奥福科技	34,985,890.88	6.98
131	301272	英华特	34,867,094.00	6.95

132	605033	美邦股份	34,854,584.00	6.95
133	301218	华是科技	34,675,001.82	6.92
134	688203	海正生材	34,641,643.80	6.91
135	688260	昀冢科技	34,636,327.58	6.91
136	001211	双枪科技	34,586,792.86	6.90
137	688216	气派科技	34,537,073.11	6.89
138	301232	飞沃科技	34,497,682.60	6.88
139	600802	福建水泥	34,391,538.18	6.86
140	002871	伟隆股份	34,368,770.41	6.86
141	300610	晨化股份	34,222,905.00	6.83
142	603810	丰山集团	34,149,242.44	6.81
143	002012	凯恩股份	34,043,916.98	6.79
144	001278	一彬科技	33,860,637.18	6.75
145	300519	新光药业	33,814,576.78	6.74
146	001255	博菲电气	33,806,606.00	6.74
147	603161	科华控股	33,558,690.06	6.69
148	688229	博睿数据	33,507,774.00	6.68
149	301313	凡拓数创	33,442,012.50	6.67
150	300564	筑博设计	33,349,045.93	6.65
151	002133	广宇集团	33,268,445.00	6.64
152	301234	五洲医疗	33,220,371.00	6.63
153	603321	梅轮电梯	33,178,893.00	6.62
154	301097	天益医疗	33,165,593.00	6.62
155	688296	和达科技	33,153,206.93	6.61
156	301126	达嘉维康	33,122,844.87	6.61
157	605287	德才股份	33,100,129.80	6.60
158	003003	天元股份	33,042,755.00	6.59
159	000985	大庆华科	33,017,454.08	6.59
160	002909	集泰股份	32,946,034.28	6.57
161	301010	晶雪节能	32,880,548.92	6.56
162	001387	雪祺电气	32,795,390.12	6.54
163	603172	万丰股份	32,569,913.00	6.50
164	301192	泰祥股份	32,413,155.58	6.47
165	002718	友邦吊顶	32,352,204.41	6.45
166	688450	光格科技	32,316,553.77	6.45
167	688215	瑞晟智能	32,243,898.71	6.43
168	688619	罗普特	32,091,068.16	6.40
169	600785	新华百货	31,992,978.00	6.38
170	300606	金太阳	31,863,881.00	6.36
171	002828	贝肯能源	31,814,402.00	6.35
172	688681	科汇股份	31,639,695.90	6.31

173	002671	龙泉股份	31,583,450.00	6.30
174	688013	天臣医疗	31,534,225.63	6.29
175	002910	庄园牧场	31,467,999.44	6.28
176	300649	杭州园林	31,420,910.36	6.27
177	603356	华菱精工	31,408,201.00	6.26
178	603048	浙江黎明	31,396,803.00	6.26
179	002397	梦洁股份	31,335,555.15	6.25
180	002921	联诚精密	31,278,833.49	6.24
181	300605	恒锋信息	31,269,967.87	6.24
182	605258	协和电子	31,202,150.00	6.22
183	301359	东南电子	31,174,449.60	6.22
184	688485	九州一轨	31,150,696.35	6.21
185	300334	津膜科技	31,099,346.00	6.20
186	600408	安泰集团	31,051,544.00	6.19
187	603073	彩蝶实业	30,985,315.99	6.18
188	002890	弘宇股份	30,850,433.60	6.15
189	002136	安纳达	30,693,348.93	6.12
190	301353	普莱得	30,597,661.20	6.10
191	301502	华阳智能	30,535,545.59	6.09
192	603080	新疆火炬	30,517,841.00	6.09
193	002144	宏达高科	30,509,859.00	6.09
194	603331	百达精工	30,451,198.00	6.07
195	301001	凯淳股份	30,434,677.84	6.07
196	300612	宣亚国际	30,412,923.00	6.07
197	300615	欣天科技	30,341,047.00	6.05
198	300417	南华仪器	30,329,251.00	6.05
199	301446	福事特	30,317,635.36	6.05
200	688517	金冠电气	30,289,266.83	6.04
201	603353	和顺石油	30,241,673.90	6.03
202	603685	晨丰科技	30,182,194.27	6.02
203	001226	拓山重工	30,171,075.00	6.02
204	603311	金海高科	30,089,630.00	6.00
205	301314	科瑞思	30,019,350.10	5.99
206	688651	盛邦安全	29,997,825.14	5.98
207	301057	汇隆新材	29,943,917.82	5.97
208	301002	崧盛股份	29,928,988.29	5.97
209	002702	海欣食品	29,908,501.00	5.97
210	605303	园林股份	29,903,457.00	5.96
211	300535	达威股份	29,843,980.29	5.95
212	002780	三夫户外	29,808,770.00	5.95
213	002856	美芝股份	29,773,919.60	5.94

214	300906	日月明	29,771,233.20	5.94
215	301072	中捷精工	29,665,913.00	5.92
216	603880	南卫股份	29,576,340.50	5.90
217	300907	康平科技	29,434,562.00	5.87
218	605151	西上海	29,413,716.00	5.87
219	688113	联测科技	29,386,650.09	5.86
220	301512	智信精密	29,041,049.01	5.79
221	603696	安记食品	29,039,728.00	5.79
222	301111	粤万年青	28,929,962.74	5.77
223	603335	迪生力	28,787,739.36	5.74
224	300554	三超新材	28,725,052.00	5.73
225	688793	倍轻松	28,330,656.52	5.65
226	301360	荣旗科技	28,322,403.22	5.65
227	002778	中晟高科	28,319,607.00	5.65
228	000593	德龙汇能	28,205,776.00	5.63
229	688355	明志科技	28,180,167.93	5.62
230	688193	仁度生物	28,178,854.87	5.62
231	002799	环球印务	28,159,559.72	5.62
232	001234	泰慕士	28,151,684.39	5.62
233	600051	宁波联合	28,140,969.00	5.61
234	605003	众望布艺	28,038,916.75	5.59
235	002800	天顺股份	27,990,945.60	5.58
236	603137	恒尚节能	27,967,877.84	5.58
237	002809	红墙股份	27,930,265.92	5.57
238	603102	百合股份	27,774,489.00	5.54
239	688038	中科通达	27,653,482.03	5.52
240	300585	奥联电子	27,613,893.00	5.51
241	000619	海螺新材	27,448,680.95	5.48
242	002853	皮阿诺	27,389,422.00	5.46
243	605255	天普股份	27,348,683.00	5.46
244	300385	雪浪环境	27,302,557.84	5.45
245	300710	万隆光电	27,194,628.20	5.42
246	301235	华康洁净	27,084,024.00	5.40
247	688466	金科环境	26,998,486.46	5.39
248	300813	泰林生物	26,974,695.26	5.38
249	600561	江西长运	26,963,251.00	5.38
250	688597	煜邦电力	26,947,564.13	5.38
251	603578	三星新材	26,903,139.16	5.37
252	002998	优彩资源	26,798,726.00	5.35
253	300155	安居宝	26,774,309.00	5.34
254	300270	中威电子	26,732,441.00	5.33

255	301049	超越科技	26,642,903.00	5.31
256	301045	天禄科技	26,641,424.28	5.31
257	600791	京能置业	26,618,289.00	5.31
258	600156	华升股份	26,618,185.00	5.31
259	301276	嘉曼服饰	26,565,325.40	5.30
260	300971	博亚精工	26,543,374.40	5.29
261	001231	农心科技	26,537,288.25	5.29
262	002806	华锋股份	26,534,984.23	5.29
263	002763	汇洁股份	26,519,977.60	5.29
264	002084	海鸥住工	26,441,614.22	5.27
265	002963	豪尔赛	26,436,500.63	5.27
266	688163	赛伦生物	26,391,641.78	5.26
267	002836	新宏泽	26,334,350.74	5.25
268	300807	天迈科技	26,309,159.00	5.25
269	002798	帝欧水华	26,154,930.75	5.22
270	000757	浩物股份	26,093,269.00	5.20
271	605180	华生科技	26,043,478.66	5.19
272	002209	达意隆	26,027,694.00	5.19
273	301022	海泰科	26,025,710.42	5.19
274	301158	德石股份	26,014,809.00	5.19
275	301197	工大科雅	25,903,588.00	5.17
276	688426	康为世纪	25,860,630.37	5.16
277	301041	金百泽	25,779,160.00	5.14
278	688638	誉辰智能	25,721,074.02	5.13
279	301555	惠柏新材	25,640,524.34	5.11
280	300883	龙利得	25,574,874.00	5.10
281	688551	科威尔	25,554,691.18	5.10
282	688045	必易微	25,509,170.62	5.09
283	300321	同大股份	25,496,775.30	5.09
284	000632	三木集团	25,483,540.00	5.08
285	300686	智动力	25,443,841.00	5.08
286	603176	汇通集团	25,405,630.84	5.07
287	001219	青岛食品	25,344,310.79	5.06
288	603028	赛福天	25,327,069.86	5.05
289	688530	欧莱新材	25,286,236.16	5.04
290	002420	毅昌科技	25,284,552.00	5.04
291	603836	海程邦达	25,281,627.00	5.04
292	002687	乔治白	25,249,340.42	5.04
293	688607	康众医疗	25,230,491.28	5.03
294	300838	浙江力诺	25,012,546.48	4.99
295	688345	博力威	24,946,415.74	4.98

296	300816	艾可蓝	24,922,341.00	4.97
297	600257	大湖股份	24,897,341.00	4.97
298	603188	亚邦股份	24,868,151.00	4.96
299	301105	鸿铭股份	24,857,097.98	4.96
300	688393	安必平	24,847,212.07	4.96
301	002719	麦趣尔	24,818,004.00	4.95
302	301167	建研设计	24,817,990.40	4.95
303	002524	光正眼科	24,674,995.00	4.92
304	300929	华骐环保	24,666,365.20	4.92
305	001336	楚环科技	24,647,009.00	4.92
306	300717	华信新材	24,621,846.00	4.91
307	002753	永东股份	24,551,330.00	4.90
308	301113	雅艺科技	24,510,398.48	4.89
309	300556	丝路视觉	24,438,014.00	4.87
310	688309	恒誉环保	24,355,937.14	4.86
311	603909	建发合诚	24,335,599.25	4.85
312	301081	严牌股份	24,334,742.32	4.85
313	003023	彩虹集团	24,231,530.00	4.83
314	600689	上海三毛	24,213,750.00	4.83
315	603968	醋化股份	24,108,285.00	4.81
316	300621	维业股份	24,043,621.00	4.80
317	603059	倍加洁	23,790,747.10	4.75
318	300637	扬帆新材	23,700,240.32	4.73
319	603329	上海雅仕	23,695,532.90	4.73
320	300305	裕兴股份	23,602,725.00	4.71
321	603725	天安新材	23,532,306.79	4.69
322	002887	绿茵生态	23,527,487.32	4.69
323	603917	合力科技	23,492,045.80	4.69
324	605177	东亚药业	23,399,398.88	4.67
325	300030	阳普医疗	23,371,162.00	4.66
326	000790	华神科技	23,349,952.83	4.66
327	301198	喜悦智行	23,266,379.06	4.64
328	688367	工大高科	23,191,818.66	4.63
329	002857	三晖电气	23,153,884.20	4.62
330	603860	中公高科	23,002,756.00	4.59
331	001228	永泰运	22,876,232.64	4.56
332	002566	益盛药业	22,790,261.85	4.55
333	002820	桂发祥	22,717,815.00	4.53
334	603903	中持股份	22,652,400.00	4.52
335	600833	第一医药	22,611,783.08	4.51
336	688022	瀚川智能	22,600,304.52	4.51

337	301390	经纬股份	22,562,777.04	4.50
338	002873	新天药业	22,524,938.37	4.49
339	300876	蒙泰高新	22,372,348.00	4.46
340	300937	药易购	22,357,753.58	4.46
341	603326	我乐家居	22,291,238.48	4.45
342	688175	高凌信息	22,227,184.17	4.43
343	300464	星徽股份	22,221,809.00	4.43
344	688350	富淼科技	22,205,218.10	4.43
345	301519	舜禹股份	22,137,814.70	4.42
346	600665	天地源	22,133,607.00	4.41
347	000637	茂化实华	22,085,971.05	4.41
348	002787	华源控股	21,953,538.71	4.38
349	002949	华阳国际	21,915,547.31	4.37
350	600235	民丰特纸	21,897,765.18	4.37
351	300549	优德精密	21,826,703.00	4.35
352	600969	郴电国际	21,799,194.40	4.35
353	603682	锦和商管	21,783,275.00	4.34
354	001368	通达创智	21,724,414.52	4.33
355	301063	海锅股份	21,693,958.00	4.33
356	688448	磁谷科技	21,645,106.75	4.32
357	002571	德力股份	21,635,838.25	4.32
358	300886	华业香料	21,583,011.42	4.31
359	603190	亚通精工	21,386,030.90	4.27
360	688237	超卓航科	21,359,266.54	4.26
361	688148	芳源股份	21,307,667.29	4.25
362	603042	华脉科技	21,269,475.29	4.24
363	301019	宁波色母	21,238,737.28	4.24
364	300966	共同药业	21,115,246.20	4.21
365	300665	飞鹿股份	20,986,142.13	4.19
366	301042	安联锐视	20,888,464.00	4.17
367	001209	洪兴股份	20,721,783.20	4.13
368	300675	建科院	20,700,755.00	4.13
369	688081	兴图新科	20,551,060.09	4.10
370	603378	亚士创能	20,539,599.95	4.10
371	002760	凤形股份	20,444,386.00	4.08
372	001218	丽臣实业	20,429,509.36	4.07
373	002682	龙洲股份	20,391,362.00	4.07
374	002795	永和智控	20,377,316.00	4.06
375	001215	千味央厨	20,339,266.38	4.06
376	605567	春雪食品	20,332,890.00	4.06
377	603289	泰瑞机器	20,263,792.20	4.04

378	600356	恒丰纸业	20,225,931.80	4.03
379	300977	深圳瑞捷	19,971,230.14	3.98
380	000548	湖南投资	19,882,552.98	3.97
381	603182	嘉华股份	19,858,686.00	3.96
382	688528	秦川物联	19,853,031.36	3.96
383	301588	美新科技	19,838,154.05	3.96
384	301170	锡南科技	19,822,088.00	3.95
385	003017	大洋生物	19,754,780.00	3.94
386	688420	美腾科技	19,725,943.33	3.93
387	300851	交大思诺	19,671,746.00	3.92
388	002775	文科股份	19,635,788.44	3.92
389	688189	南新制药	19,616,448.82	3.91
390	601996	丰林集团	19,456,001.00	3.88
391	688218	江苏北人	19,436,734.64	3.88
392	688669	聚石化学	19,392,223.49	3.87
393	301237	和顺科技	19,389,694.78	3.87
394	300295	三六五网	19,242,114.16	3.84
395	600719	大连热电	19,196,427.00	3.83
396	688335	复洁科技	19,121,033.15	3.81
397	688109	品茗科技	19,120,230.92	3.81
398	300780	德恩精工	19,088,032.00	3.81
399	001333	光华股份	19,013,890.00	3.79
400	002492	恒基达鑫	18,930,704.47	3.78
401	002576	通达动力	18,927,703.00	3.78
402	001326	联域股份	18,810,679.00	3.75
403	301505	苏州规划	18,786,226.59	3.75
404	301130	西点药业	18,727,749.00	3.74
405	300329	海伦钢琴	18,669,646.00	3.72
406	600692	亚通股份	18,654,925.13	3.72
407	688171	纬德信息	18,641,065.54	3.72
408	301257	普蕊斯	18,625,861.20	3.72
409	301298	东利机械	18,605,501.50	3.71
410	603208	江山欧派	18,485,552.99	3.69
411	300707	威唐工业	18,446,656.00	3.68
412	603908	牧高笛	18,291,405.60	3.65
413	001266	宏英智能	18,257,964.24	3.64
414	300086	康芝药业	18,181,637.00	3.63
415	002861	瀛通通讯	18,142,555.00	3.62
416	600540	新赛股份	18,130,400.80	3.62
417	603282	亚光股份	18,005,584.41	3.59
418	301059	金三江	17,995,258.50	3.59

419	300958	建工修复	17,887,884.00	3.57
420	603488	展鹏科技	17,868,132.05	3.56
421	301107	瑜欣电子	17,739,032.00	3.54
422	301203	国泰环保	17,729,795.00	3.54
423	688655	迅捷兴	17,682,235.58	3.53
424	301448	开创电气	17,643,389.50	3.52
425	603090	宏盛股份	17,572,137.00	3.51
426	300692	中赋科技	17,542,268.00	3.50
427	002743	富煌钢构	17,491,969.00	3.49
428	603122	合富中国	17,488,241.00	3.49
429	300422	博世科	17,391,412.28	3.47
430	002767	先锋电子	17,344,541.00	3.46
431	688323	瑞华泰	17,336,657.13	3.46
432	600371	万向德农	17,319,461.40	3.45
433	002066	瑞泰科技	17,254,307.00	3.44
434	603755	日辰股份	17,242,009.85	3.44
435	000798	中水渔业	17,241,427.00	3.44
436	300849	锦盛新材	17,113,877.00	3.41
437	688618	三旺通信	16,963,358.42	3.38
438	002451	摩恩电气	16,955,632.98	3.38
439	688307	中润光学	16,925,452.89	3.38
440	301098	金埔园林	16,897,615.00	3.37
441	600303	曙光股份	16,877,693.00	3.37
442	603829	洛凯股份	16,860,111.96	3.36
443	300594	朗进科技	16,832,148.00	3.36
444	688338	赛科希德	16,796,915.77	3.35
445	300591	万里马	16,738,081.78	3.34
446	688098	申联生物	16,668,873.12	3.32
447	002893	京能热力	16,648,477.05	3.32
448	688170	德龙激光	16,633,507.86	3.32
449	300786	国林科技	16,460,276.00	3.28
450	301027	华蓝集团	16,447,860.75	3.28
451	300839	博汇股份	16,384,400.74	3.27
452	603320	迪贝电气	16,255,978.00	3.24
453	300732	设研院	16,228,474.72	3.24
454	301233	盛帮股份	16,191,223.00	3.23
455	600448	华纺股份	16,177,649.80	3.23
456	603183	建研院	16,114,368.20	3.21
457	300597	吉大通信	16,054,025.00	3.20
458	001373	翔腾新材	15,983,539.00	3.19
459	301079	邵阳液压	15,971,508.00	3.19

460	600883	博闻科技	15,906,642.00	3.17
461	603214	爱婴室	15,708,496.00	3.13
462	301321	翰博高新	15,621,494.00	3.12
463	301122	采纳股份	15,489,617.50	3.09
464	688118	普元信息	15,402,579.46	3.07
465	600749	西藏旅游	15,048,192.00	3.00
466	300923	研奥股份	15,003,154.00	2.99
467	688560	明冠新材	15,002,687.70	2.99
468	003042	中农联合	14,991,966.00	2.99
469	300242	佳云科技	14,890,330.00	2.97
470	300743	天地数码	14,879,982.07	2.97
471	603900	莱绅通灵	14,851,012.00	2.96
472	301108	洁雅股份	14,787,413.80	2.95
473	000635	英力特	14,694,386.00	2.93
474	688291	金橙子	14,649,144.78	2.92
475	300947	德必集团	14,638,546.65	2.92
476	688069	德林海	14,557,760.59	2.90
477	300651	金陵体育	14,461,081.00	2.88
478	603136	天目湖	14,345,908.55	2.86
479	603839	安正时尚	14,292,418.40	2.85
480	603307	扬州金泉	14,270,113.00	2.85
481	603029	天鹅股份	14,247,183.00	2.84
482	603051	鹿山新材	14,229,343.15	2.84
483	603385	惠达卫浴	14,212,746.10	2.83
484	300721	怡达股份	14,204,147.60	2.83
485	301156	美农生物	14,130,052.00	2.82
486	603926	铁流股份	14,101,058.70	2.81
487	603221	爱丽家居	14,013,416.00	2.80
488	600774	汉商集团	13,987,387.80	2.79
489	600099	林海股份	13,976,472.00	2.79
490	002942	新农股份	13,906,726.10	2.77
491	600539	狮头股份	13,888,962.99	2.77
492	688011	新光光电	13,686,290.10	2.73
493	600337	美克家居	13,665,661.00	2.73
494	605069	正和生态	13,655,384.00	2.72
495	600573	惠泉啤酒	13,631,791.00	2.72
496	601007	金陵饭店	13,305,815.00	2.65
497	301056	森赫股份	13,300,678.11	2.65
498	603332	苏州龙杰	13,266,837.14	2.65
499	603729	龙韵股份	13,252,689.00	2.64
500	600615	鑫源智造	13,232,574.00	2.64

501	002842	翔鹭钨业	13,220,414.08	2.64
502	688310	迈得医疗	13,197,846.47	2.63
503	300565	科信技术	13,172,930.00	2.63
504	603937	丽岛新材	13,162,223.00	2.63
505	001299	美能能源	13,090,542.20	2.61
506	300826	测绘股份	13,026,230.44	2.60
507	001324	长青科技	12,919,996.00	2.58
508	603700	宁水集团	12,827,380.00	2.56
509	603982	泉峰汽车	12,639,075.00	2.52
510	301388	欣灵电气	12,580,196.02	2.51
511	688051	佳华科技	12,548,874.50	2.50
512	300538	同益股份	12,508,959.10	2.50
513	002574	明牌珠宝	12,470,670.00	2.49
514	300642	透景生命	12,394,880.00	2.47
515	300647	超频三	12,370,604.00	2.47
516	300877	金春股份	12,366,024.00	2.47
517	688060	云涌科技	12,165,477.17	2.43
518	301185	鸥玛软件	12,134,812.56	2.42
519	300254	仟源医药	12,063,618.00	2.41
520	002205	国统股份	12,025,199.26	2.40
521	300562	乐心医疗	11,954,512.20	2.38
522	688479	友车科技	11,748,765.56	2.34
523	300560	中富通	11,728,188.00	2.34
524	301279	金道科技	11,689,564.47	2.33
525	000715	中兴商业	11,608,304.40	2.32
526	300427	红相股份	11,514,363.84	2.30
527	688129	东来技术	11,485,794.49	2.29
528	688121	卓然股份	11,369,023.25	2.27
529	300771	智莱科技	11,238,869.00	2.24
530	600128	苏豪弘业	11,189,015.00	2.23
531	301539	宏鑫科技	11,169,297.00	2.23
532	001277	速达股份	11,106,065.00	2.22
533	300804	广康生化	11,069,960.68	2.21
534	605566	福莱蒽特	10,839,782.00	2.16
535	001268	联合精密	10,568,144.00	2.11
536	000545	金浦钛业	10,465,799.00	2.09
537	002712	思美传媒	10,454,125.70	2.09
538	002999	天禾股份	10,362,183.00	2.07
539	000803	山高环能	10,267,799.88	2.05
540	688500	慧辰股份	10,265,119.60	2.05
541	603895	天永智能	10,259,280.00	2.05

542	300920	润阳科技	10,066,567.00	2.01
543	000573	粤宏远 A	10,065,482.00	2.01

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。

8.4.3 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	18,087,177,423.21
卖出股票收入（成交）总额	15,711,660,669.30

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,525,456.14
2	应收清算款	14,942,962.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,253,270.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,721,688.69

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
诺安多策略混合 A	95,494	6,726.53	48,703,008.22	7.58%	593,640,714.78	92.42%
诺安多策略混合 C	168,405	3,739.86	80,813,190.69	12.83%	548,997,397.07	87.17%
合计	263,899	4,820.61	129,516,198.91	10.18%	1,142,638,111.85	89.82%

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。

9.2 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	诺安多策略混合 A	1,522,958.21	0.2371%
	诺安多策略混合 C	443,297.46	0.0704%
	合计	1,966,255.67	0.1546%

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	诺安多策略混合 A	>100
	诺安多策略混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安多策略混合 A	50~100
	诺安多策略混合 C	10~50
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
基金合同生效日（2011 年 08 月 09 日）基金份额总额	1,249,071,475.18	-
本报告期期初基金份额总额	259,811,667.77	-
本报告期基金总申购份额	1,640,344,675.37	2,559,844,938.31
减：本报告期基金总赎回份额	1,257,812,620.14	1,930,034,350.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	642,343,723.00	629,810,587.76

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

王蓓女士担任公司董事，王学明先生不再担任公司董事；高蔚卿先生、王斌先生担任公司独立董事，汤小青先生、史其禄先生不再担任公司独立董事；刘翔先生担任公司副总经理，杨谷先生不再担任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 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。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为人民币 60,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未发生受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未发生受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
光大证券	1	15,200,807,108.50	44.98%	1,457,824.75	44.98%	-
广发证券	1	6,459.00	0.00%	0.17	0.00%	本报告期新增
华西证券	1	13,671,631,568.69	40.46%	1,311,121.74	40.46%	-
江海证券	1	8,697,634.42	0.03%	833.98	0.03%	本报告期退租
首创证券	1	4,911,892,363.95	14.54%	471,070.72	14.54%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 2 个交易单元：长江证券（1 个交易单元）、广发证券（1 个交易单元）。

本报告期退租 1 个证券公司 1 个交易单元：江海证券（1 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

（1）依法取得相关业务资格；

（2）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；

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金进行证券交易的需要；

（4）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；

（5）能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；

基金管理人根据以上标准进行充分评估后，选定证券公司，并在完成公司内部审批流程后，与之签订相关协议。

11.7.2 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未进行其他证券投资交易。

11.8 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旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
2	诺安多策略混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加云湾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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
4	诺安多策略混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 11 日
5	诺安多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 11 日
6	诺安多策略混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 11 日
7	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 11 日
8	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 1 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 11 日
9	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 13 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息为销售机构并开通转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 14 日
11	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 19 日
12	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 21 日
13	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加华泰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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 28 日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	中国证监会规定报刊及	2025 年 03 月 05

	金增加华宝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	网站	日
15	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加国金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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 13 日
16	诺安多策略混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
17	诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
18	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加银河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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 01 日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 01 日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行招赢通平台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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 02 日
21	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 03 日
22	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 11 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长江证券为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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 14 日
24	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加英大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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 17 日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 18 日
26	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 19 日
27	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025	中国证监会规定报刊及	2025 年 04 月 22

	年第 1 季度报告提示性公告	网站	日
28	诺安多策略混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 22 日
29	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 25 日
30	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 30 日
31	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加华源证券鑫理财平台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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 13 日
32	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加联泰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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 15 日
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加邮储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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 16 日
34	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加东方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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 16 日
35	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加中信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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 20 日
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 20 日
37	诺安多策略混合型证券投资基金限制大额申购（含定投）、转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 04 日
38	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加财达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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 05 日
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行招赢通平台为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 06 日

	优惠活动的公告		
40	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加汇成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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 09 日
41	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 11 日
42	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 2 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 11 日
43	诺安多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 11 日
44	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 16 日
45	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 16 日
46	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 07 日
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行融联创同业交易平台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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 07 日
48	诺安多策略混合型证券投资基金调整大额申购（含定投）、转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 09 日
49	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加长城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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 15 日
50	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加国泰海通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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 16 日
51	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 18 日
52	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 21 日
53	诺安多策略混合型证券投资基金 2025	中国证监会规定报刊及	2025 年 07 月 21

	年第 2 季度报告	网站	日
54	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加江海证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 25 日
55	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加银泰证券为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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 28 日
56	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加微众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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 28 日
57	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加平安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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 28 日
58	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 31 日
59	诺安多策略混合型证券投资基金调整大额申购（含定投）、转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 31 日
60	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 01 日
61	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加太平洋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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 08 日
62	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加东方财富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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 12 日
63	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 25 日
64	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 25 日
65	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 3 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 28 日

66	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务并修改基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 28 日
67	诺安多策略混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 28 日
68	诺安多策略混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
69	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 29 日
70	诺安多策略混合型证券投资基金调整大额申购（含定投）、转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 09 月 08 日
71	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华瑞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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 09 月 29 日
72	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加奕丰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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 17 日
73	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广源达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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 24 日
74	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加陆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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 24 日
75	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
76	诺安多策略混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
77	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北交所上市股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 31 日
78	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏宁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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 04 日
79	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 07 日

80	诺安多策略混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 08 日
81	诺安基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 11 日
82	诺安多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 11 日
83	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2025 年第 4 期	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 11 日
84	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 12 日
85	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加光大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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 18 日
86	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合 C 增加国融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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 11 月 25 日
87	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合增加山西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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 01 日
88	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信银行中信同业+平台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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 12 日
89	诺安基金管理有限公司关于诺安多策略混合增加浙商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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 12 日
90	诺安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 13 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

投资者类别	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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2025 年 8 月 28 日披露了《诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务并修改基金合同的公告》，自 2025 年 8 月 28 日起，本基金开通同一基金不同类别基金份额间的转换业务。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安多策略股票型证券投资基金募集的文件。

②《诺安多策略混合型证券投资基金基金合同》。

③《诺安多策略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多策略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报告期内诺安多策略混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 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

2026 年 03 月 31 日