

诺安多策略混合型证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55

7.12	投资组合报告附注	55
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12	备查文件目录	63
12.1	备查文件目录	63
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§ 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	918,536,455.55 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	515,520,379.55 份	403,016,076.00 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，本基金增加 C 类基金份额，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	<p>本基金将实施积极主动的投资策略，具体由资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略以及股指期货投资策略六个部分组成。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>4. 债券投资策略 本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。</p> <p>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</p>

	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
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	021-60637228
传真	0755-83026677	021-60635778
注册地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李强	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	诺安多策略混合 A	诺安多策略混合 C
本期已实现收益	175,502,171.98	94,611,930.02

本期利润	272,815,483.86	137,746,813.48
加权平均基金份额本期利润	0.8225	0.8048
本期加权平均净值利润率	35.87%	32.93%
本期基金份额净值增长率	40.62%	29.42%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末(2025年06月30日)
期末可供分配利润	711,566,173.34	554,736,858.31
期末可供分配基金份额利润	1.3803	1.3765
期末基金资产净值	1,398,971,659.70	1,092,039,215.34
期末基金份额净值	2.714	2.710
3.1.3 累计期末指标		报告期末(2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	171.40%	29.42%

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
过去一个月	8.60%	1.15%	2.00%	0.43%	6.60%	0.72%
过去三个月	23.98%	1.91%	1.32%	0.81%	22.66%	1.10%
过去六个月	40.62%	1.78%	0.48%	0.76%	40.14%	1.02%
过去一年	100.44%	2.07%	12.06%	1.03%	88.38%	1.04%
过去三年	30.17%	1.97%	-5.21%	0.82%	35.38%	1.15%
自基金合同生效起至今	171.40%	1.59%	57.87%	1.02%	113.53%	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
过去一个月	8.57%	1.15%	2.00%	0.43%	6.57%	0.72%
过去三个月	23.86%	1.90%	1.32%	0.81%	22.54%	1.09%
自基金合同生效起至今	29.42%	1.73%	1.27%	0.75%	28.15%	0.98%

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



注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 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	-	8年	硕士, 具有基金从业资格。2017年1月加入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月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理, 2023年3月起任诺安中证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	-	13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, 现任多资产投资部总经理兼国际业务部总经理。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。

					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指根据公司决定确定的聘任日期;

②证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

交易执行方面, 对于场内交易, 基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能, 交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令, 如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令, 并且市价在指令限价以内, 投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合; 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易

分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本产品取得了较好收益，波动也相对较小，表现在历史上属于较为平稳的时期。验证了我们从前认为中小盘股中存在大量机会的想法。目前整体板块估值处在历史平均偏高一些位置，但离极值仍有较远距离，我们难以预测平稳期会持续多久，但我们会努力继续做好超额收益。

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 2.714 元，本报告期诺安多策略混合 A 份额净值增长率为 40.62%，同期业绩比较基准收益率为 0.48%；截至本报告期末诺安多策略混合 C 份额净值为 2.710 元，本报告期诺安多策略混合 C 份额净值增长率为 29.42%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年经济数据表现强劲部分源于美国关税政策下的抢出口行为，而下半年这部分支撑因素面临消退，国内经济的运行可能会出现一定压力。值得关注的是，近期国内出现一定需求端政策发力加码的迹象，尤其是雅鲁藏布江水电站建设开工，配合大范围“反内卷”的供给侧改革，下半年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和传统消费品可能会阶段性出现估值的快速修复和悲观情绪转暖。短期我们还未观察到经济基本面因此发生实质性的扭转，但物价层面确实出现了向上的拐点，未来我们会紧密跟踪企业利润受此影响产生的变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	206,199,308.17	39,298,078.29
结算备付金		7,660,632.08	1,139,374.45
存出保证金		544,823.37	139,621.62
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	2,339,729,765.49	475,281,284.29
其中：股票投资		2,339,729,765.49	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	6. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	—	—
应收清算款		—	1,525,794.48
应收股利		—	—
应收申购款		53,816,912.92	5,164,379.16
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 5	—	—
资产总计		2,607,951,442.03	522,548,532.29
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30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	6. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		73,834,618.74	—
应付赎回款		39,706,429.18	20,139,477.04
应付管理人报酬		2,077,297.37	595,769.24
应付托管费		346,216.23	99,294.90

应付销售服务费		298,114.15	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 6	677,891.32	371,116.70
负债合计		116,940,566.99	21,205,657.88
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 7	918,536,455.55	259,811,667.77
未分配利润	6. 4. 7. 8	1,572,474,419.49	241,531,206.64
净资产合计		2,491,010,875.04	501,342,874.41
负债和净资产总计		2,607,951,442.03	522,548,532.29

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，诺安多策略混合 A 基金份额净值 2.714 元，基金份额总额 515,520,379.55 份；诺安多策略混合 C 基金份额净值 2.710 元，基金份额总额 403,016,076.00 份。诺安多策略混合份额总额合计为 918,536,455.55 份。

6.2 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 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业收入		418,763,695.32	-194,046,846.40
1. 利息收入		176,780.73	72,164.74
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 9	176,780.73	72,164.74
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）		275,248,871.56	-170,634,082.87
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 10	267,375,698.59	-171,974,519.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 12	-	-
股利收益	6. 4. 7. 13	7,873,172.97	1,340,436.55
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 14	140,448,195.34	-25,976,744.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 15	2, 889, 847. 69	2, 491, 815. 85
减：二、营业总支出		8, 201, 397. 98	2, 342, 346. 22
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	6, 402, 013. 78	1, 917, 205. 79
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 067, 002. 31	319, 534. 27
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	646, 078. 86	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 17	86, 303. 03	105, 606. 16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		410, 562, 297. 34	-196, 389, 192. 62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		410, 562, 297. 34	-196, 389, 192. 62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		410, 562, 297. 34	-196, 389, 192. 62

6.3 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 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	658, 724, 787. 78	1, 330, 943, 212. 85	1, 989, 668, 000. 63
(一)、综合收益总额	-	410, 562, 297. 34	410, 562, 297. 34
(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）	658, 724, 787. 78	920, 380, 915. 51	1, 579, 105, 703. 29
其中：1. 基金申购款	1, 327, 705, 135. 93	1, 794, 561, 578. 49	3, 122, 266, 714. 42
2. 基金赎回款	-668, 980, 348. 15	-874, 180, 662. 98	-1, 543, 161, 011. 13
(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	918, 536, 455. 55	1, 572, 474, 419. 49	2, 491, 010, 875. 04
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计

一、上期期末净资产	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）	-132,173,573.88	-179,520,892.06	-311,694,465.94
(一)、综合收益总额	-	-196,389,192.62	-196,389,192.62
(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）	-132,173,573.88	16,868,300.56	-115,305,273.32
其中：1. 基金申购款	679,324,628.54	313,822,991.91	993,147,620.45
2. 基金赎回款	-811,498,202.42	-296,954,691.35	-1,108,452,893.77
(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	168,064,579.42	59,553,554.02	227,618,133.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

齐斌	田冲	何柳姿
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×75%+上证国债指数×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于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《证券投资基金管理信息披露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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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6月30日的财务状况以及2025年1月1日至6月30日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后

取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	206,199,308.17
等于： 本金	206,183,346.10
加： 应计利息	15,962.07
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	206,199,308.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,235,832,965.10	-	2,339,729,765.49	103,896,800.39
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	2,235,832,965.10	-	2,339,729,765.49	103,896,800.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	57,136.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	538,931.91
其中：交易所市场	538,931.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	677,891.32

6.4.7.7 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06月30日	基金份额(份)
上年度末	259,811,667.77	259,811,667.77
本期申购	667,437,555.12	667,437,555.12
本期赎回(以“-”号填列)	-411,728,843.34	-411,728,843.34
本期末	515,520,379.55	515,520,379.55

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06月30日	基金份额(份)
上年度末	-	-
本期申购	660,267,580.81	660,267,580.81
本期赎回(以“-”号填列)	-257,251,504.81	-257,251,504.81
本期末	403,016,076.00	403,016,076.00

6.4.7.8 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	175,502,171.98	97,313,311.88	272,815,483.86
本期基金份额交易产生的变动数	301,962,330.51	67,142,259.14	369,104,589.65
其中：基金申购款	733,140,075.58	137,634,191.80	870,774,267.38
基金赎回款	-431,177,745.07	-70,491,932.66	-501,669,677.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	711,566,173.34	171,885,106.81	883,451,280.15

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	94,611,930.02	43,134,883.46	137,746,813.48
本期基金份额交易产生的变动数	460,124,928.29	91,151,397.57	551,276,325.86
其中：基金申购款	774,322,486.50	149,464,824.61	923,787,311.11
基金赎回款	-314,197,558.21	-58,313,427.04	-372,510,985.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	554,736,858.31	134,286,281.03	689,023,139.34

6.4.7.9 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 06 月 30 日
活期存款利息收入	168,351.42
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	6,416.89
其他	2,012.42
合计	176,780.73

注：此处“其他”列示的是存出保证金利息收入及申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	3,093,385,952.45
减：卖出股票成本总额	2,823,241,204.32
减：交易费用	2,769,049.54
买卖股票差价收入	267,375,698.59

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,873,172.97
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	7,873,172.97

6.4.7.14 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 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	140,448,195.34
—股票投资	140,448,195.34
—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	140,448,195.34

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	2,840,330.59
其他	49,517.10
合计	2,889,847.69

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	4,480.17
合计	86,303.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,402,013.78	1,917,205.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,037,444.91	648,711.51
应支付基金管理人的净管理费	4,364,568.87	1,268,494.28

注：本基金的管理费率为年费率 1.20%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年 06月30日	2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,067,002.31	319,534.27

注：本基金的托管费率为年费率 0.20%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年01月01日至2025年06月30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
诺安基金管理有限公司	-	91,693.98	91,693.98
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	91,693.98	91,693.98
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06月30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
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：

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银 行股份有限公 司-活期存款	206,199,308.17	168,351.42	15,359,360.99	57,478.58

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2025 年 06 月 30 日基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025年04月02日	6个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025年01月16日	6个月	新股锁定	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025年03月13日	6个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年06月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年06月24日	6个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年05月21日	6个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年01月20日	6个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025年02月24日	6个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
30127	汉朔	2025年	6个月	新股锁	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-

5	科技	03 月 04 日		定						
30145	钧崴电子	2025 年 01 月 02 日	6 个月	新股锁定	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
30147	弘景光电	2025 年 03 月 06 日	6 个月	新股锁定	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
30150	恒鑫生活	2025 年 03 月 11 日	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
30153	浙江华远	2025 年 03 月 18 日	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
30156	众捷汽车	2025 年 04 月 17 日	6 个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
30159	优优绿能	2025 年 05 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
30159	太力科技	2025 年 05 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
30160	惠通科技	2025 年 01 月 08 日	6 个月	新股锁定	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
30160	超研股份	2025 年 01 月 15 日	6 个月	新股锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
30163	泽润新能	2025 年 04 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
30165	首航新能	2025 年 03 月 26 日	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
30166	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
30166	泰禾股份	2025 年 04 月 02 日	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
30167	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

		日									
60301 4	威高 血净	2025 年 05 月 12 日	6 个月	新股锁 定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-	-
60304 9	中策 橡胶	2025 年 05 月 27 日	6 个月	新股锁 定	46.50	42.85	565	26,272.50	24,210.25	-	-
60307 2	天和 磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-	-
60312 0	肯特 催化	2025 年 04 月 09 日	6 个月	新股锁 定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-	-
60312 4	江南 新材	2025 年 03 月 12 日	6 个月	新股锁 定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-	-
60320 2	天有 为	2025 年 04 月 16 日	6 个月	新股锁 定	93.50	90.66	121	11,313.50	10,969.86	-	-
60321 0	泰鸿 万立	2025 年 04 月 01 日	6 个月	新股锁 定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-	-
60325 7	中国 瑞林	2025 年 03 月 28 日	6 个月	新股锁 定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-	-
60327 1	永杰 新材	2025 年 03 月 04 日	6 个月	新股锁 定	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-	-
60338 2	海阳 科技	2025 年 06 月 05 日	6 个月	新股锁 定	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-	-
60340 0	华之 杰	2025 年 06 月 12 日	6 个月	新股锁 定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-	-
60340 9	汇通 控股	2025 年 02 月 25 日	6 个月	新股锁 定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-	-
68841 1	海博 思创	2025 年 01 月 20 日	6 个月	新股锁 定	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-	-
68854 5	兴福 电子	2025 年 01 月 15 日	6 个月	新股锁 定	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-	-

688583	思看科技	2025年01月08日	6个月	新股锁定	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025年05月09日	6个月	新股锁定	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年03月18日	6个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年01月02日	6个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

注：1、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

2、本基金持有的流通受限股票“688583 思看科技”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股；本基金持有的流通受限股票“301479 弘景光电”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股；本基金持有的流通受限股票“301501 恒鑫生活”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4.5 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于

股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常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次风险管理架构体系。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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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 06 月 30 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）。

6.4.13.3 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 06 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理指引》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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例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 06

月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06月30 日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	206,199,308.17	-	-	-	-	206,199,308.17
结算备付金	7,660,632.08	-	-	-	-	7,660,632.08
存出保证金	544,823.37	-	-	-	-	544,823.37
交易性金融资产	-	-	-	-2,339,729,765.49	2,339,729,765.49	
应收申购款	-	-	-	-53,816,912.92	53,816,912.92	
资产总计	214,404,763.62	-	-	-2,393,546,678.41	2,607,951,442.03	
负债						
应付清算款	-	-	-	-73,834,618.74	73,834,618.74	
应付赎回款	-	-	-	-39,706,429.18	39,706,429.18	

应付管理人报酬	-	-	-	-	2,077,297.37	2,077,297.37
应付托管费	-	-	-	-	346,216.23	346,216.23
应付销售服务费	-	-	-	-	298,114.15	298,114.15
其他负债	-	-	-	-	677,891.32	677,891.32
负债总计	-	-	-	-	116,940,566.99	116,940,566.99
利率敏感度缺口	214,404,763.62	-	-	-	-2,276,606,111.42	2,491,010,875.04
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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2025年06月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(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)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 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	2,339,729,765. 49	93.93	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	2,339,729,765. 49	93.93	475,281,284. 29	94.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2025 年 06 月 30 日)	上年度末(2024 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	176,376,594.07	27,125,966.99
	业绩比较基准下降 5%	-176,376,594.07	-27,125,966.99

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	2,339,279,708.92	471,669,988.11
第二层次	15,385.54	3,113,294.50
第三层次	434,671.03	498,001.68
合计	2,339,729,765.49	475,281,284.29

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 06 月 30 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）。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,339,729,765.49	89.72
	其中：股票	2,339,729,765.49	89.72
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	213,859,940.25	8.20
8	其他各项资产	54,361,736.29	2.08
9	合计	2,607,951,442.03	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	40,932,476.44	1.64
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,743,235,791.81	69.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,430,992.60	0.54
E	建筑业	53,886,671.00	2.16
F	批发和零售业	66,685,623.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,476,277.15	5.64
J	金融业	—	—
K	房地产业	30,683,163.00	1.23
L	租赁和商务服务业	18,602,593.50	0.75
M	科学研究和技术服务业	125,753,657.40	5.05
N	水利、环境和公共设施管理业	85,909,154.59	3.45

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,408,050.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	9,725,315.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	2,339,729,765.49	93.93

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002798	帝欧家居	1,712,500	11,353,875.00	0.46
2	688022	瀚川智能	751,500	11,137,230.00	0.45
3	605180	华生科技	752,100	11,131,080.00	0.45
4	300813	泰林生物	511,211	10,945,027.51	0.44
5	688565	力源科技	1,181,500	10,928,875.00	0.44
6	002494	华斯股份	2,146,300	10,924,667.00	0.44
7	600847	万里股份	989,900	10,888,900.00	0.44
8	300665	飞鹿股份	1,293,400	10,812,824.00	0.43
9	688737	中自科技	502,564	10,805,126.00	0.43
10	301448	开创电气	420,400	10,774,852.00	0.43
11	688081	兴图新科	517,186	10,762,640.66	0.43
12	688045	必易微	312,118	10,736,859.20	0.43
13	300931	通用电梯	1,404,300	10,714,809.00	0.43
14	300780	德恩精工	664,200	10,686,978.00	0.43
15	688026	洁特生物	650,600	10,669,840.00	0.43
16	301298	东利机械	645,400	10,662,008.00	0.43
17	301037	保立佳	828,100	10,657,647.00	0.43
18	002591	恒大高新	1,746,000	10,650,600.00	0.43
19	002209	达意隆	848,100	10,643,655.00	0.43
20	301359	东南电子	516,740	10,639,676.60	0.43
21	603778	国晟科技	3,160,800	10,620,288.00	0.43
22	003011	海象新材	577,900	10,616,023.00	0.43
23	688058	宝兰德	370,100	10,610,767.00	0.43
24	300912	凯龙高科	722,311	10,610,748.59	0.43
25	002963	豪尔赛	835,900	10,607,571.00	0.43
26	001225	和泰机电	304,300	10,595,726.00	0.43
27	002420	毅昌科技	1,697,800	10,594,272.00	0.43
28	001255	博菲电气	328,200	10,591,014.00	0.43
29	603488	展鹏科技	1,283,300	10,587,225.00	0.43

30	300749	顶固集创	1,258,600	10,584,826.00	0.42
31	300549	优德精密	578,600	10,582,594.00	0.42
32	300371	汇中股份	911,949	10,578,608.40	0.42
33	603090	宏盛股份	433,000	10,552,210.00	0.42
34	688013	天臣医疗	360,200	10,528,646.00	0.42
35	688109	品茗科技	338,000	10,521,940.00	0.42
36	300535	达威股份	633,800	10,514,742.00	0.42
37	002084	海鸥住工	2,960,800	10,510,840.00	0.42
38	688296	和达科技	800,512	10,510,722.56	0.42
39	688229	博睿数据	206,263	10,509,099.85	0.42
40	300845	捷安高科	939,760	10,506,516.80	0.42
41	300923	研奥股份	421,300	10,490,370.00	0.42
42	301010	晶雪节能	612,500	10,486,000.00	0.42
43	301057	汇隆新材	637,500	10,480,500.00	0.42
44	002760	凤形股份	541,600	10,479,960.00	0.42
45	603458	勘设股份	1,324,400	10,476,004.00	0.42
46	002295	精艺股份	1,234,900	10,471,952.00	0.42
47	688004	博汇科技	526,154	10,470,464.60	0.42
48	300614	百川畅银	786,400	10,466,984.00	0.42
49	002871	伟隆股份	939,816	10,460,152.08	0.42
50	688395	正弦电气	461,100	10,457,748.00	0.42
51	688693	锴威特	316,800	10,457,568.00	0.42
52	301502	华阳智能	257,300	10,448,953.00	0.42
53	603073	彩蝶实业	619,800	10,443,630.00	0.42
54	301072	中捷精工	486,400	10,443,008.00	0.42
55	301353	普莱得	412,140	10,435,384.80	0.42
56	300948	冠中生态	958,100	10,433,709.00	0.42
57	301113	雅艺科技	498,730	10,428,444.30	0.42
58	300707	威唐工业	755,000	10,426,550.00	0.42
59	301126	达嘉维康	939,800	10,422,382.00	0.42
60	300626	华瑞股份	968,500	10,421,060.00	0.42
61	301049	超越科技	436,500	10,414,890.00	0.42
62	002696	百洋股份	1,715,500	10,413,085.00	0.42
63	001373	翔腾新材	346,600	10,411,864.00	0.42
64	002524	光正眼科	2,312,900	10,408,050.00	0.42
65	001209	洪兴股份	580,600	10,404,352.00	0.42
66	300417	南华仪器	831,600	10,403,316.00	0.42
67	001210	金房能源	759,740	10,400,840.60	0.42
68	301336	趣睡科技	184,400	10,400,160.00	0.42
69	300883	龙利得	1,671,800	10,398,596.00	0.42
70	301198	喜悦智行	929,073	10,396,326.87	0.42

71	301388	欣灵电气	422,300	10,392,803.00	0.42
72	300970	华绿生物	716,500	10,389,250.00	0.42
73	603860	中公高科	333,800	10,387,856.00	0.42
74	002836	新宏泽	1,101,983	10,380,679.86	0.42
75	300668	杰恩设计	597,600	10,380,312.00	0.42
76	600791	京能置业	2,194,200	10,378,566.00	0.42
77	600097	开创国际	993,901	10,376,326.44	0.42
78	002883	中设股份	919,640	10,373,539.20	0.42
79	002802	洪汇新材	741,300	10,370,787.00	0.42
80	300305	裕兴股份	1,624,800	10,366,224.00	0.42
81	002687	乔治白	2,234,017	10,365,838.88	0.42
82	300086	康芝药业	1,908,700	10,364,241.00	0.42
83	002890	弘宇股份	785,760	10,364,174.40	0.42
84	600235	民丰特纸	1,657,700	10,360,625.00	0.42
85	001336	楚环科技	487,100	10,360,617.00	0.42
86	301001	凯淳股份	326,500	10,359,845.00	0.42
87	002910	庄园牧场	1,099,600	10,358,232.00	0.42
88	688056	莱伯泰科	310,311	10,358,181.18	0.42
89	600159	大龙地产	3,766,300	10,357,325.00	0.42
90	003008	开普检测	487,400	10,357,250.00	0.42
91	300838	浙江力诺	712,300	10,356,842.00	0.42
92	688695	中创股份	348,656	10,355,083.20	0.42
93	603700	宁水集团	863,800	10,348,324.00	0.42
94	603937	丽岛新材	1,058,100	10,348,218.00	0.42
95	603172	万丰股份	649,300	10,343,349.00	0.42
96	301272	英华特	288,000	10,339,200.00	0.42
97	001211	双枪科技	453,000	10,332,930.00	0.41
98	300732	设研院	1,430,900	10,331,098.00	0.41
99	301512	智信精密	244,800	10,320,768.00	0.41
100	300621	维业股份	1,160,600	10,317,734.00	0.41
101	300412	迦南科技	2,030,970	10,317,327.60	0.41
102	301163	宏德股份	412,200	10,305,000.00	0.41
103	601996	丰林集团	4,748,800	10,304,896.00	0.41
104	688307	中润光学	362,200	10,300,968.00	0.41
105	300030	阳普医疗	1,498,500	10,294,695.00	0.41
106	600615	丰华股份	922,080	10,290,412.80	0.41
107	002817	黄山胶囊	1,394,300	10,289,934.00	0.41
108	300500	启迪设计	846,700	10,287,405.00	0.41
109	002144	宏达高科	880,000	10,287,200.00	0.41
110	301167	建研设计	644,500	10,286,220.00	0.41
111	603331	百达精工	990,900	10,285,542.00	0.41

112	301295	美硕科技	431,000	10,283,660.00	0.41
113	300642	透景生命	698,200	10,277,504.00	0.41
114	300519	新光药业	692,344	10,274,384.96	0.41
115	301519	舜禹股份	747,500	10,270,650.00	0.41
116	688067	爱威科技	477,388	10,268,615.88	0.41
117	605567	春雪食品	1,003,400	10,264,782.00	0.41
118	603903	中持股份	1,314,200	10,263,902.00	0.41
119	603385	惠达卫浴	1,545,600	10,262,784.00	0.41
120	300877	金春股份	635,800	10,261,812.00	0.41
121	605177	东亚药业	555,430	10,258,792.10	0.41
122	300929	华骐环保	971,300	10,256,928.00	0.41
123	300851	交大思诺	372,300	10,256,865.00	0.41
124	688215	瑞晟智能	269,700	10,253,994.00	0.41
125	300670	大烨智能	1,557,800	10,250,324.00	0.41
126	688038	中科通达	645,862	10,249,829.94	0.41
127	301390	经纬股份	283,600	10,243,632.00	0.41
128	300717	华信新材	564,900	10,241,637.00	0.41
129	002820	桂发祥	883,600	10,240,924.00	0.41
130	688323	瑞华泰	705,675	10,239,344.25	0.41
131	300594	朗进科技	562,400	10,235,680.00	0.41
132	603968	醋化股份	898,500	10,215,945.00	0.41
133	001366	播恩集团	836,600	10,214,886.00	0.41
134	001226	拓山重工	366,800	10,211,712.00	0.41
135	003030	祖名股份	553,500	10,206,540.00	0.41
136	300385	雪浪环境	1,907,200	10,203,520.00	0.41
137	301429	森泰股份	555,100	10,202,738.00	0.41
138	603717	天域生物	1,407,100	10,201,475.00	0.41
139	300935	盈建科	412,900	10,198,630.00	0.41
140	600356	恒丰纸业	1,266,840	10,198,062.00	0.41
141	000790	华神科技	2,628,300	10,197,804.00	0.41
142	600883	博闻科技	1,298,500	10,193,225.00	0.41
143	301065	本立科技	461,900	10,189,514.00	0.41
144	603029	天鹅股份	568,200	10,182,144.00	0.41
145	600099	林海股份	939,100	10,179,844.00	0.41
146	001260	坤泰股份	540,300	10,173,849.00	0.41
147	301300	远翔新材	284,800	10,173,056.00	0.41
148	301053	远信工业	360,700	10,171,740.00	0.41
149	301235	华康洁净	429,950	10,164,018.00	0.41
150	688448	磁谷科技	346,664	10,153,788.56	0.41
151	300270	中威电子	1,291,700	10,152,762.00	0.41
152	300329	海伦钢琴	1,339,200	10,151,136.00	0.41

153	001259	利仁科技	397,201	10,144,513.54	0.41
154	603356	华菱精工	745,800	10,142,880.00	0.41
155	002909	集泰股份	1,624,800	10,138,752.00	0.41
156	300675	建科院	685,000	10,138,000.00	0.41
157	603183	建研院	2,390,700	10,136,568.00	0.41
158	688260	昀冢科技	614,435	10,125,888.80	0.41
159	301273	瑞晨环保	414,800	10,121,120.00	0.41
160	688118	普元信息	452,500	10,113,375.00	0.41
161	300966	共同药业	551,000	10,099,830.00	0.41
162	301276	嘉曼服饰	555,100	10,097,269.00	0.41
163	300141	和顺电气	1,099,800	10,085,166.00	0.40
164	603177	德创环保	1,107,700	10,080,070.00	0.40
165	300615	欣天科技	753,200	10,070,284.00	0.40
166	605155	西大门	840,200	10,057,194.00	0.40
167	300334	津膜科技	1,463,300	10,052,871.00	0.40
168	600802	福建水泥	2,160,400	10,045,860.00	0.40
169	301446	福事特	426,050	10,029,217.00	0.40
170	002873	新天药业	1,073,100	10,022,754.00	0.40
171	002830	名雕股份	654,800	9,979,152.00	0.40
172	603188	亚邦股份	2,363,800	9,975,236.00	0.40
173	002679	福建金森	1,043,500	9,965,425.00	0.40
174	300823	建科智能	668,900	9,959,921.00	0.40
175	603908	牧高笛	401,840	9,949,558.40	0.40
176	002133	广宇集团	3,406,600	9,947,272.00	0.40
177	002718	友邦吊顶	627,100	9,933,264.00	0.40
178	600408	安泰集团	4,818,600	9,926,316.00	0.40
179	301006	迈拓股份	636,100	9,884,994.00	0.40
180	300658	延江股份	1,527,785	9,884,768.95	0.40
181	300906	日月明	359,200	9,878,000.00	0.40
182	002719	麦趣尔	1,095,900	9,874,059.00	0.40
183	001231	农心科技	490,300	9,864,836.00	0.40
184	300710	万隆光电	494,300	9,826,684.00	0.39
185	301234	五洲医疗	327,900	9,807,489.00	0.39
186	002999	天禾股份	1,404,800	9,805,504.00	0.39
187	603182	嘉华股份	737,200	9,804,760.00	0.39
188	688216	气派科技	427,400	9,800,282.00	0.39
189	000632	三木集团	2,373,600	9,779,232.00	0.39
190	603329	上海雅仕	867,870	9,763,537.50	0.39
191	301043	绿岛风	317,000	9,750,920.00	0.39
192	301231	荣信文化	420,100	9,725,315.00	0.39
193	301355	南王科技	809,100	9,660,654.00	0.39

194	301081	严牌股份	1,000,352	9,653,396.80	0.39
195	000955	欣龙控股	2,051,700	9,642,990.00	0.39
196	002853	皮阿诺	700,200	9,599,742.00	0.39
197	301045	天禄科技	409,900	9,386,710.00	0.38
198	688189	南新制药	1,259,200	9,368,448.00	0.38
199	301257	普蕊斯	301,100	9,273,880.00	0.37
200	600774	汉商集团	1,085,400	9,204,192.00	0.37
201	001387	雪祺电气	668,770	9,188,899.80	0.37
202	301097	天益医疗	228,000	9,117,720.00	0.37
203	600539	狮头股份	834,700	8,914,596.00	0.36
204	603729	龙韵股份	516,300	8,839,056.00	0.35
205	688113	联测科技	240,787	8,714,081.53	0.35
206	603028	赛福天	1,165,430	8,542,601.90	0.34
207	000757	浩物股份	1,850,400	8,382,312.00	0.34
208	301588	美新科技	450,727	8,365,493.12	0.34
209	603779	威龙股份	1,116,500	8,295,595.00	0.33
210	001326	联域股份	241,800	8,230,872.00	0.33
211	603321	梅轮电梯	1,054,800	8,227,440.00	0.33
212	603637	镇海股份	733,800	7,895,688.00	0.32
213	001218	丽臣实业	413,400	7,544,550.00	0.30
214	603282	亚光股份	439,429	7,483,475.87	0.30
215	603041	美思德	620,600	7,360,316.00	0.30
216	300103	达刚控股	930,400	6,336,024.00	0.25
217	301314	科瑞思	105,250	4,229,997.50	0.17
218	300605	恒锋信息	211,300	3,152,596.00	0.13
219	688251	井松智能	145,700	3,141,292.00	0.13
220	688021	奥福科技	204,900	3,132,921.00	0.13
221	300509	新美星	365,400	3,127,824.00	0.13
222	300517	海波重科	281,200	3,118,508.00	0.13
223	688485	九州一轨	285,700	3,111,273.00	0.12
224	002571	德力股份	508,401	3,101,246.10	0.12
225	688171	纬德信息	100,700	3,097,532.00	0.12
226	688426	康为世纪	139,500	3,092,715.00	0.12
227	688659	元琛科技	353,400	3,085,182.00	0.12
228	000985	大庆华科	167,300	3,079,993.00	0.12
229	300556	丝路视觉	154,600	3,071,902.00	0.12
230	688078	龙软科技	96,900	3,071,730.00	0.12
231	301469	恒达新材	115,300	3,057,756.00	0.12
232	300955	嘉亨家化	156,700	3,055,650.00	0.12
233	301131	聚赛龙	67,900	3,055,500.00	0.12
234	300246	宝莱特	382,200	3,053,778.00	0.12

235	603909	建发合诚	313,500	3,053,490.00	0.12
236	002795	永和智控	588,200	3,052,758.00	0.12
237	688638	誉辰智能	78,500	3,050,510.00	0.12
238	300405	科隆股份	539,600	3,048,740.00	0.12
239	688163	赛伦生物	156,700	3,047,815.00	0.12
240	301133	金钟股份	134,200	3,043,656.00	0.12
241	600444	国机通用	185,300	3,042,626.00	0.12
242	301218	华是科技	142,700	3,042,364.00	0.12
243	002857	三晖电气	157,900	3,039,575.00	0.12
244	301515	港通医疗	149,400	3,037,302.00	0.12
245	000605	渤海股份	429,200	3,030,152.00	0.12
246	603059	倍加洁	122,800	3,028,248.00	0.12
247	301105	鸿铭股份	81,500	3,026,095.00	0.12
248	300610	晨化股份	265,000	3,021,000.00	0.12
249	301130	西点药业	107,800	3,018,400.00	0.12
250	600448	华纺股份	864,600	3,017,454.00	0.12
251	002702	海欣食品	721,200	3,014,616.00	0.12
252	600697	欧亚集团	249,000	3,012,900.00	0.12
253	605122	四方新材	256,600	3,012,484.00	0.12
254	688616	西力科技	236,200	3,004,464.00	0.12
255	600051	宁波联合	413,800	3,004,188.00	0.12
256	600689	上海三毛	246,100	3,002,420.00	0.12
257	603709	中源家居	229,500	2,997,270.00	0.12
258	002778	中晟高科	157,600	2,937,664.00	0.12
259	301111	粤万年青	180,000	2,845,800.00	0.11
260	605189	富春染织	190,480	2,365,761.60	0.09
261	688681	科汇股份	150,000	2,100,000.00	0.08
262	301125	腾亚精工	103,236	1,820,050.68	0.07
263	301098	金埔园林	200,000	1,804,000.00	0.07
264	688551	科威尔	60,000	1,763,400.00	0.07
265	688455	科捷智能	110,000	1,547,700.00	0.06
266	301232	飞沃科技	50,000	1,536,500.00	0.06
267	600137	浪莎股份	80,000	1,515,200.00	0.06
268	688517	金冠电气	105,000	1,509,900.00	0.06
269	688092	爱科科技	38,092	849,451.60	0.03
270	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
271	603400	华之杰	569	31,875.73	0.00
272	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
273	603049	中策橡胶	565	24,210.25	0.00
274	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
275	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00

276	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
277	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
278	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
279	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
280	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
281	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
282	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
283	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
284	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
285	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
286	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
287	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
288	603202	天有为	121	10,969.86	0.00
289	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
290	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
291	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
292	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
293	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
294	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
295	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
296	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
297	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
298	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
299	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
300	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
301	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
302	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
303	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
304	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
305	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
306	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
307	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
308	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
309	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300614	百川畅银	20,449,786.00	4.08

2	688251	井松智能	20,052,449.19	4.00
3	300813	泰林生物	19,776,358.94	3.94
4	688395	正弦电气	19,188,632.36	3.83
5	301125	腾亚精工	18,680,353.32	3.73
6	300610	晨化股份	18,269,325.00	3.64
7	301300	远翔新材	18,250,180.00	3.64
8	001225	和泰机电	18,128,081.00	3.62
9	688215	瑞晟智能	17,526,920.51	3.50
10	301314	科瑞思	17,520,188.50	3.49
11	003008	开普检测	17,180,040.80	3.43
12	002591	恒大高新	17,051,977.98	3.40
13	001373	翔腾新材	17,028,078.95	3.40
14	300935	盈建科	16,972,794.82	3.39
15	301519	舜禹股份	16,955,037.00	3.38
16	688013	天臣医疗	16,919,986.18	3.37
17	600051	宁波联合	16,652,954.18	3.32
18	600697	欧亚集团	16,534,111.00	3.30
19	300955	嘉亨家化	16,488,107.00	3.29
20	301057	汇隆新材	16,349,952.00	3.26
21	688260	昀冢科技	16,315,866.99	3.25
22	688189	南新制药	16,277,406.75	3.25
23	605122	四方新材	16,236,299.60	3.24
24	002144	宏达高科	16,191,087.00	3.23
25	301043	绿岛风	16,162,593.00	3.22
26	002798	帝欧家居	16,123,632.80	3.22
27	301231	荣信文化	16,039,306.00	3.20
28	301053	远信工业	16,011,228.45	3.19
29	603331	百达精工	15,984,940.00	3.19
30	300845	捷安高科	15,919,969.04	3.18
31	688163	赛伦生物	15,791,642.50	3.15
32	002494	华斯股份	15,759,043.00	3.14
33	688737	中自科技	15,721,977.24	3.14
34	301072	中捷精工	15,698,892.00	3.13
35	301298	东利机械	15,386,439.00	3.07
36	301502	华阳智能	15,362,135.00	3.06
37	688448	磁谷科技	15,356,222.46	3.06
38	301049	超越科技	15,337,896.00	3.06
39	301512	智信精密	15,329,662.00	3.06
40	688004	博汇科技	15,306,082.38	3.05
41	002873	新天药业	15,292,273.11	3.05
42	301448	开创电气	15,265,682.70	3.04

43	301257	普蕊斯	15, 261, 911. 00	3. 04
44	002963	豪尔赛	15, 254, 137. 00	3. 04
45	301235	华康洁净	15, 215, 049. 50	3. 03
46	002909	集泰股份	15, 143, 390. 38	3. 02
47	603488	展鹏科技	15, 116, 641. 00	3. 02
48	301469	恒达新材	15, 066, 101. 40	3. 01
49	002836	新宏泽	15, 060, 726. 38	3. 00
50	001226	拓山重工	15, 052, 896. 00	3. 00
51	002719	麦趣尔	15, 017, 615. 00	3. 00
52	300849	锦盛新材	14, 980, 880. 20	2. 99
53	688307	中润光学	14, 932, 381. 60	2. 98
54	688573	信宇人	14, 929, 788. 51	2. 98
55	001255	博菲电气	14, 872, 170. 00	2. 97
56	300668	杰恩设计	14, 800, 351. 00	2. 95
57	000985	大庆华科	14, 784, 546. 20	2. 95
58	688216	气派科技	14, 772, 540. 61	2. 95
59	300923	研奥股份	14, 734, 195. 02	2. 94
60	000757	浩物股份	14, 629, 723. 00	2. 92
61	001259	利仁科技	14, 511, 699. 56	2. 89
62	300837	浙矿股份	14, 422, 959. 00	2. 88
63	603029	天鹅股份	14, 380, 209. 10	2. 87
64	002921	联诚精密	14, 379, 057. 64	2. 87
65	301272	英华特	14, 359, 934. 73	2. 86
66	688328	深科达	14, 327, 909. 95	2. 86
67	603090	宏盛股份	14, 326, 332. 00	2. 86
68	300246	宝莱特	14, 294, 587. 64	2. 85
69	301359	东南电子	14, 237, 161. 80	2. 84
70	301276	嘉曼服饰	14, 235, 287. 34	2. 84
71	300838	浙江力诺	14, 200, 124. 00	2. 83
72	600097	开创国际	14, 185, 261. 18	2. 83
73	600444	国机通用	14, 120, 575. 00	2. 82
74	300086	康芝药业	14, 082, 324. 00	2. 81
75	300710	万隆光电	14, 078, 228. 11	2. 81
76	605177	东亚药业	14, 061, 846. 92	2. 80
77	605567	春雪食品	14, 035, 098. 00	2. 80
78	003030	祖名股份	13, 975, 181. 00	2. 79
79	688092	爱科科技	13, 975, 170. 48	2. 79
80	600408	安泰集团	13, 887, 039. 00	2. 77
81	300519	新光药业	13, 880, 014. 48	2. 77
82	300665	飞鹿股份	13, 809, 156. 80	2. 75
83	300621	维业股份	13, 778, 768. 00	2. 75

84	688693	楷威特	13, 776, 063. 24	2. 75
85	603188	亚邦股份	13, 724, 261. 00	2. 74
86	688565	力源科技	13, 705, 836. 56	2. 73
87	603700	宁水集团	13, 692, 706. 00	2. 73
88	301097	天益医疗	13, 677, 709. 00	2. 73
89	300626	华瑞股份	13, 668, 664. 00	2. 73
90	603860	中公高科	13, 659, 438. 02	2. 72
91	603329	上海雅仕	13, 640, 578. 20	2. 72
92	300556	丝路视觉	13, 585, 163. 00	2. 71
93	688329	艾隆科技	13, 490, 791. 53	2. 69
94	301232	飞沃科技	13, 486, 538. 00	2. 69
95	688113	联测科技	13, 462, 266. 01	2. 69
96	002295	精艺股份	13, 440, 913. 00	2. 68
97	003011	海象新材	13, 435, 856. 00	2. 68
98	605155	西大门	13, 430, 030. 00	2. 68
99	688038	中科通达	13, 414, 619. 67	2. 68
100	301113	雅艺科技	13, 332, 374. 70	2. 66
101	001260	坤泰股份	13, 331, 525. 96	2. 66
102	603321	梅轮电梯	13, 307, 190. 00	2. 65
103	301131	聚赛龙	13, 251, 835. 22	2. 64
104	603709	中源家居	13, 209, 908. 45	2. 63
105	300270	中威电子	13, 178, 721. 98	2. 63
106	301163	宏德股份	13, 146, 144. 00	2. 62
107	301198	喜悦智行	13, 076, 364. 69	2. 61
108	002778	中晟高科	13, 054, 162. 40	2. 60
109	300883	龙利得	13, 028, 145. 00	2. 60
110	300305	裕兴股份	13, 022, 224. 00	2. 60
111	603041	美思德	13, 003, 328. 00	2. 59
112	002133	广宇集团	12, 979, 074. 00	2. 59
113	000632	三木集团	12, 955, 244. 99	2. 58
114	688659	元琛科技	12, 904, 847. 52	2. 57
115	301429	森泰股份	12, 898, 647. 00	2. 57
116	603778	国晟科技	12, 788, 823. 00	2. 55
117	688026	洁特生物	12, 786, 985. 77	2. 55
118	002702	海欣食品	12, 748, 492. 38	2. 54
119	002715	登云股份	12, 737, 887. 00	2. 54
120	301515	港通医疗	12, 685, 956. 00	2. 53
121	001202	炬申股份	12, 628, 206. 00	2. 52
122	688118	普元信息	12, 618, 076. 20	2. 52
123	002890	弘宇股份	12, 611, 913. 58	2. 52
124	688296	和达科技	12, 574, 416. 49	2. 51

125	688616	西力科技	12,572,926.32	2.51
126	600883	博闻科技	12,564,016.00	2.51
127	600689	上海三毛	12,561,910.00	2.51
128	300732	设研院	12,408,169.87	2.47
129	688426	康为世纪	12,291,621.43	2.45
130	300103	达刚控股	12,290,567.00	2.45
131	688067	爱威科技	12,286,522.12	2.45
132	301065	本立科技	12,270,477.00	2.45
133	300992	泰福泵业	12,252,649.04	2.44
134	301555	惠柏新材	12,151,284.03	2.42
135	600356	恒丰纸业	12,123,778.85	2.42
136	300749	顶固集创	12,114,144.92	2.42
137	688109	品茗科技	12,104,766.43	2.41
138	605287	德才股份	12,059,797.60	2.41
139	002760	凤形股份	12,010,736.00	2.40
140	002887	绿茵生态	11,986,461.00	2.39
141	603729	龙韵股份	11,912,211.00	2.38
142	001387	雪祺电气	11,884,027.70	2.37
143	001209	洪兴股份	11,876,422.00	2.37
144	688078	龙软科技	11,850,972.97	2.36
145	300329	海伦钢琴	11,811,511.00	2.36
146	001218	丽臣实业	11,794,665.20	2.35
147	603073	彩蝶实业	11,749,997.00	2.34
148	002696	百洋股份	11,709,599.90	2.34
149	301118	恒光股份	11,639,714.00	2.32
150	003017	大洋生物	11,611,302.00	2.32
151	300823	建科智能	11,592,991.00	2.31
152	002084	海鸥住工	11,590,171.67	2.31
153	001210	金房能源	11,589,031.38	2.31
154	002205	国统股份	11,579,218.96	2.31
155	002857	三晖电气	11,534,004.20	2.30
156	300591	万里马	11,506,581.50	2.30
157	301045	天禄科技	11,469,602.40	2.29
158	603458	勘设股份	11,443,408.00	2.28
159	603182	嘉华股份	11,326,065.00	2.26
160	002795	永和智控	11,323,373.84	2.26
161	301133	金钟股份	11,319,613.00	2.26
162	688011	新光光电	11,273,243.88	2.25
163	300839	博汇股份	11,270,957.34	2.25
164	300907	康平科技	11,251,284.09	2.24
165	001336	楚环科技	11,235,507.00	2.24

166	605003	众望布艺	11,142,245.00	2.22
167	603968	醋化股份	11,128,715.00	2.22
168	002209	达意隆	11,065,890.00	2.21
169	301001	凯淳股份	11,058,291.00	2.21
170	603356	华菱精工	11,027,235.00	2.20
171	300931	通用电梯	10,977,785.00	2.19
172	300970	华绿生物	10,958,019.00	2.19
173	300929	华骐环保	10,948,854.20	2.18
174	001234	泰慕士	10,945,992.00	2.18
175	001366	播恩集团	10,938,719.00	2.18
176	688681	科汇股份	10,937,962.75	2.18
177	688551	科威尔	10,890,012.67	2.17
178	002820	桂发祥	10,852,899.00	2.16
179	301218	华是科技	10,843,555.00	2.16
180	300635	中达安	10,725,238.04	2.14
181	300334	津膜科技	10,703,381.00	2.13
182	603183	建研院	10,697,769.00	2.13
183	688081	兴图新科	10,695,792.36	2.13
184	002679	福建金森	10,656,565.22	2.13
185	688229	博睿数据	10,622,290.65	2.12
186	301126	达嘉维康	10,610,217.00	2.12
187	300371	汇中股份	10,589,024.78	2.11
188	301588	美新科技	10,583,350.29	2.11
189	002802	洪汇新材	10,571,907.00	2.11
190	300405	科隆股份	10,561,714.00	2.11
191	301006	迈拓股份	10,436,478.20	2.08
192	300640	德艺文创	10,428,490.00	2.08
193	300615	欣天科技	10,424,712.00	2.08
194	301037	保立佳	10,419,500.60	2.08
195	301273	瑞晨环保	10,409,220.00	2.08
196	301390	经纬股份	10,367,585.00	2.07
197	002871	伟隆股份	10,355,144.88	2.07
198	688345	博力威	10,276,423.07	2.05
199	301148	嘉戎技术	10,267,543.36	2.05
200	003023	彩虹集团	10,260,910.00	2.05
201	301336	趣睡科技	10,260,198.00	2.05
202	002420	毅昌科技	10,259,378.00	2.05
203	002910	庄园牧场	10,252,193.00	2.04
204	301197	工大科雅	10,249,070.00	2.04
205	000955	欣龙控股	10,246,776.00	2.04
206	301010	晶雪节能	10,240,144.00	2.04

207	688045	必易微	10,225,649.83	2.04
208	300658	延江股份	10,225,460.70	2.04
209	688058	宝兰德	10,211,012.75	2.04
210	605180	华生科技	10,210,051.00	2.04
211	002883	中设股份	10,177,560.84	2.03
212	688056	莱伯泰科	10,175,215.85	2.03
213	300509	新美星	10,172,764.00	2.03
214	688021	奥福科技	10,168,103.65	2.03
215	300649	杭州园林	10,160,106.00	2.03
216	600847	万里股份	10,153,936.00	2.03
217	300707	威唐工业	10,139,240.00	2.02
218	601996	丰林集团	10,122,327.00	2.02
219	300417	南华仪器	10,121,779.05	2.02
220	002687	乔治白	10,087,424.65	2.01
221	300549	优德精密	10,083,038.00	2.01

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	301125	腾亚精工	19,674,425.16	3.92
2	688251	井松智能	18,234,760.03	3.64
3	001202	炬申股份	17,978,473.62	3.59
4	688573	信宇人	17,929,429.92	3.58
5	600051	宁波联合	17,668,863.00	3.52
6	300849	锦盛新材	17,113,877.00	3.41
7	300591	万里马	16,738,081.78	3.34
8	300610	晨化股份	16,448,800.00	3.28
9	300839	博汇股份	16,384,400.74	3.27
10	603022	新通联	16,316,797.00	3.25
11	002921	联诚精密	16,295,268.00	3.25
12	003017	大洋生物	16,010,219.00	3.19
13	301022	海泰科	15,784,864.42	3.15
14	301232	飞沃科技	15,678,982.60	3.13
15	300955	嘉亨家化	15,676,529.93	3.13
16	688328	深科达	15,591,132.32	3.11
17	300246	宝莱特	15,162,215.50	3.02
18	603045	福达合金	14,876,635.00	2.97
19	300837	浙矿股份	14,708,855.00	2.93
20	001234	泰慕士	14,644,538.95	2.92
21	600697	欧亚集团	14,638,069.00	2.92

22	600232	金鹰股份	14,526,968.00	2.90
23	688329	艾隆科技	14,305,320.23	2.85
24	603161	科华控股	14,238,964.46	2.84
25	301118	恒光股份	14,134,816.58	2.82
26	603709	中源家居	14,078,475.34	2.81
27	605122	四方新材	14,058,726.38	2.80
28	605255	天普股份	13,806,401.00	2.75
29	300907	康平科技	13,802,072.00	2.75
30	688011	新光光电	13,686,290.10	2.73
31	688092	爱科科技	13,630,794.14	2.72
32	002828	贝肯能源	13,566,932.00	2.71
33	301075	多瑞医药	13,505,546.00	2.69
34	301314	科瑞思	13,499,181.50	2.69
35	002715	登云股份	13,470,669.00	2.69
36	300992	泰福泵业	13,279,997.00	2.65
37	603332	苏州龙杰	13,111,382.14	2.62
38	301555	惠柏新材	12,764,965.24	2.55
39	301515	港通医疗	12,699,668.80	2.53
40	605287	德才股份	12,621,132.00	2.52
41	300614	百川畅银	12,618,636.00	2.52
42	300635	中达安	12,604,406.86	2.51
43	688051	佳华科技	12,548,874.50	2.50
44	688163	赛伦生物	12,529,907.60	2.50
45	300651	金陵体育	12,528,544.00	2.50
46	688156	路德环境	12,425,220.43	2.48
47	002857	三晖电气	12,349,289.20	2.46
48	000985	大庆华科	12,289,012.08	2.45
49	301469	恒达新材	12,088,735.00	2.41
50	002887	绿茵生态	12,067,704.00	2.41
51	002205	国统股份	12,025,199.26	2.40
52	301197	工大科雅	11,969,104.00	2.39
53	600444	国机通用	11,852,297.99	2.36
54	300640	德艺文创	11,838,066.00	2.36
55	605003	众望布艺	11,633,770.50	2.32
56	301148	嘉戎技术	11,619,549.30	2.32
57	603880	南卫股份	11,479,892.50	2.29
58	300649	杭州园林	11,471,371.00	2.29
59	603685	晨丰科技	11,428,236.61	2.28
60	688291	金橙子	11,380,717.17	2.27
61	688619	罗普特	11,328,831.04	2.26
62	688659	元琛科技	11,292,497.51	2.25

63	301057	汇隆新材	11,288,068.52	2.25
64	301053	远信工业	11,235,560.49	2.24
65	301287	康力源	11,215,988.00	2.24
66	688345	博力威	11,100,126.81	2.21
67	301158	德石股份	11,095,372.00	2.21
68	300971	博亚精工	11,005,915.40	2.20
69	301131	聚赛龙	10,980,317.00	2.19
70	301192	泰祥股份	10,979,750.00	2.19
71	603139	康惠制药	10,960,457.00	2.19
72	603725	天安新材	10,939,124.33	2.18
73	300556	丝路视觉	10,897,089.00	2.17
74	002778	中晟高科	10,875,473.00	2.17
75	301105	鸿铭股份	10,822,590.01	2.16
76	300804	广康生化	10,789,606.68	2.15
77	003023	彩虹集团	10,735,261.00	2.14
78	301040	中环海陆	10,690,318.00	2.13
79	300845	捷安高科	10,597,150.04	2.11
80	003008	开普检测	10,595,845.90	2.11
81	001268	联合精密	10,568,144.00	2.11
82	688616	西力科技	10,558,682.55	2.11
83	688607	康众医疗	10,547,935.15	2.10
84	300813	泰林生物	10,526,964.60	2.10
85	000545	金浦钛业	10,465,799.00	2.09
86	002136	安纳达	10,385,407.68	2.07
87	605033	美邦股份	10,339,703.00	2.06
88	301002	崧盛股份	10,339,210.00	2.06
89	300886	华业香料	10,267,023.82	2.05
90	688500	慧辰股份	10,265,119.60	2.05
91	002144	宏达高科	10,255,565.00	2.05
92	688272	富吉瑞	10,171,259.48	2.03
93	605303	园林股份	10,150,536.00	2.02
94	600137	浪莎股份	10,141,354.94	2.02
95	301313	凡拓数创	10,086,256.00	2.01
96	003003	天元股份	10,070,269.00	2.01
97	300920	润阳科技	10,066,567.00	2.01
98	001278	一彬科技	10,058,743.00	2.01
99	603331	百达精工	10,038,410.00	2.00

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,547,241,490.18
卖出股票收入（成交）总额	3,093,385,952.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州瀚川智能科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会江苏监管局、上海证券交易所的行政监督管理措施，浙江华生科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会浙江监管局的行政监督管理措施，浙江泰林生物技术股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会浙江监管局的行政监督管理措施。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	544,823.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,816,912.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,361,736.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
诺安多策略混合 A	48,802	10,563.51	109,192,548.16	21.18%	406,327,831.39	78.82%
诺安多策略混合 C	36,268	11,112.17	128,191,940.77	31.81%	274,824,135.23	68.19%
合计	85,070	10,797.42	237,384,488.9	25.84%	681,151,966.6	74.16%

			3		2	
--	--	--	---	--	---	--

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺安多策略混合 A	1,218,389.28	0.2363%
	诺安多策略混合 C	278,437.81	0.0691%
	合计	1,496,827.09	0.1630%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 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	667,437,555.12	660,267,580.81
减：本报告期基金总赎回份额	411,728,843.34	257,251,504.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	515,520,379.55	403,016,076.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
光大证券	1	4,174,600,848.05	54.65%	400,352.47	54.65%	-
华西证券	1	2,982,778,605.83	39.05%	286,056.72	39.05%	-
江海证券	1	8,697,634.42	0.11%	833.98	0.11%	-
首创证券	1	472,598,014.66	6.19%	45,324.72	6.19%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易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，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，能为本基金提供全面的信息服务；
- (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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金租用的证券公司交易单元本报告期未进行其他证券投资交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安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
2	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
3	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01月22日

	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	网站	
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
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	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月05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
19	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
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 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年04月22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	中国证监会规定报刊及	2025年05月13日

	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	网站	
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优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年06月06日
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（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
42	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
43	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

44	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
45	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2025 年 08 月 29 日