

# 诺安多策略混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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：2024 年 03 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 2024 年 03 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§ 6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	15
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	净资产变动表	19
7.4	报表附注	20
§ 8	投资组合报告	45
8.1	期末基金资产组合情况	45
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	71

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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12	投资组合报告附注.....	72
§ 9	基金份额持有人信息.....	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
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.....	73
§ 10	开放式基金份额变动.....	73
§ 11	重大事件揭示.....	73
11.1	基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4	基金投资策略的改变.....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8	其他重大事件.....	75
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§ 13	备查文件目录.....	78
13.1	备查文件目录.....	78
13.2	存放地点.....	79
13.3	查阅方式.....	79

## § 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	300,238,153.30 份
基金合同存续期	不定期

注：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”。

### 2.2 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，进行稳健投资。</p> <p>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。</p>

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	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	20,008,163.46	-4,752,648.29	12,515,723.70
本期利润	21,097,396.75	-5,206,473.60	213,070.55
加权平均基金份额本期利润	0.4285	-0.5467	0.0070
本期加权平均净值利润率	25.05%	-28.10%	0.32%
本期基金份额净值增长率	5.52%	-24.36%	2.13%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	239,074,446.08	6,569,959.10	12,072,327.09
期末可供分配基金份额利润	0.7963	0.7018	1.2495
期末基金资产净值	539,312,599.38	15,931,527.72	21,733,848.92
期末基金份额净值	1.796	1.702	2.250
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	79.60%	70.20%	125.00%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

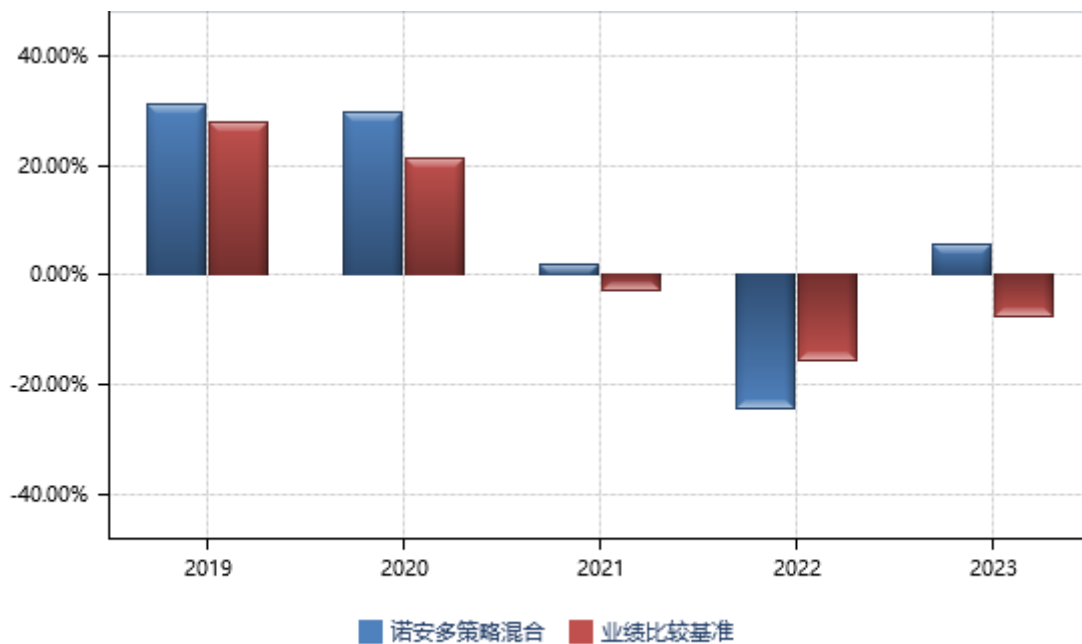
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.06%	1.11%	-5.08%	0.59%	13.14%	0.52%
过去六个月	19.57%	1.05%	-7.69%	0.64%	27.26%	0.41%
过去一年	5.52%	1.03%	-7.65%	0.63%	13.17%	0.40%
过去三年	-18.47%	1.13%	-24.14%	0.84%	5.67%	0.29%
过去五年	38.69%	1.18%	17.73%	0.91%	20.96%	0.27%
自基金合同生效起至今	79.60%	1.43%	38.48%	1.03%	41.12%	0.40%

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

### 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



### 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



### 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 2023 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 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (LOF)、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金 (LOF)、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

王海畅	本基金基金经理	2022 年 11 月 03 日	-	7 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 7 月起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 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式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 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	-	12 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，现任量化与创新投资部总经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式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、诺安汇利灵活配置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。

注：①此处基金经理的任职日期指根据公司决定确定的聘任日期；

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

### 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测，确保公平对待其管理的所有投资组合。

本报告期内，不存在本组合基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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

2023 年的市场表现一波三折，一月份在高景气预期下市场出现了较好的反弹，二季度在 ChatGPT 为代表的科技革命浪潮中出现了一段 TMT 的牛市，但可惜的是后续没有转化为预期中的高盈利后持续调整。大盘后续也在 PMI 等经济数据不及预期的压力下出现了较大幅度的调整，尤其是 8 月之后出现了单边调整的态势。全年整体上是小盘风格和红利风格相对于机构重仓股占优。我们在产品中坚持了小盘风格，采用量化方式分散投资，并采用有效的规律和因子对组合进行优化，力求跨越波折，为客户提供长期收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.796 元，本报告期内基金份额净值增长率为 5.52%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，以社融为代表的各项数据出现了企稳的势头，春节期间白酒、免税、文旅均出现了同比增长，显示消费等领域出现了复苏的势头。后期主要观察消费、地产和基建方面的刺激政策的力度以确定市场反弹弹性。通胀目前仍处于较低位置，预期货币政策仍会保持宽松态势。

权益市场方面，主要公司估值普遍进入历史较为底部区间，机构重仓股经过了较长时间的估值消化后性价比也在逐步抬升。同时，多个指数 ETF 出现放量买入的情况，前期股票超跌所带来的风

险得到了一定程度的缓解。中小盘也进入了历史估值的底部区间，根据 2015 和 2018 年类似情况的经验，后续预期会有较为显著的反弹。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以合规、监察、稽核为主导的工作体系和流程。合规管理部门依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度基金管理人合规管理、内部风险控制、监察稽核的具体情况如下：

合规管理方面，基金管理人积极开展法律法规的宣导及培训，督促各业务部门落实监管要求，持续完善公司内部制度建设，防范各类合规风险。风险控制方面，基金管理人基金的日常投资运作进行持续的监督管理，加强基金流动性风险管理，确保基金资产的合规运作。监察稽核方面，根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，基金管理人在报告期内通过定期稽核和专项稽核等方式对公司内部控制制度、业务操作流程、基金销售、宣传推介、投资运作、后台保障、反洗钱等公司业务环节和工作岗位进行了重点监控与稽核。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由合规管理部门跟踪问题的处理情况。同时，基金管理人督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 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

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%; 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

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

#### 4.9 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 2023 年 09 月 05 日,本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。基金管理人积极与基金托管人协商解决方案,包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等,并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本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	普华永道中天审字(2024)第 24472 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	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>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”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于诺安多策略基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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 2023 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。</p> <p>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。</p> <p>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。基于我们已经执行的工作,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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(一)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。</p> <p>(二)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。</p> <p>(三)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。</p> <p>(四)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。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	周祎   肖菊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 28 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: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------



		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	38,701,388.47	892,182.10
结算备付金		1,351,487.77	281,000.78
存出保证金		58,749.31	23,075.48
交易性金融资产	7.4.7.2	506,884,868.84	14,931,289.00
其中：股票投资		506,884,868.84	14,931,289.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,804,483.71	12,910.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		555,800,978.10	16,140,457.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,665,942.90	-
应付赎回款		12,415,132.53	1,478.70
应付管理人报酬		454,823.56	21,134.67
应付托管费		75,803.96	3,522.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	19.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	876,675.77	182,775.16
负债合计		16,488,378.72	208,930.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	300,238,153.30	9,361,568.62
未分配利润	7.4.7.8	239,074,446.08	6,569,959.10
净资产合计		539,312,599.38	15,931,527.72
负债和净资产总计		555,800,978.10	16,140,457.73

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.796 元，基金份额总额 300,238,153.30 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		22,428,833.94	-4,852,934.76
1. 利息收入		25,418.37	16,445.09
其中：存款利息收入	7.4.7.9	25,418.37	16,067.94
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		-	377.15
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,008,266.52	-4,417,630.14
其中：股票投资收益	7.4.7.10	20,889,468.52	-4,520,324.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,533.87	-56,059.96
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	116,264.13	158,754.14
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	1,089,233.29	-453,825.31
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	305,915.76	2,075.60
<b>减：二、营业总支出</b>		1,331,437.19	353,538.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,013,170.22	277,892.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	168,861.81	46,315.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		0.11	6.29
8. 其他费用	7.4.7.17	149,405.05	29,325.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		21,097,396.75	-5,206,473.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		21,097,396.75	-5,206,473.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		21,097,396.75	-5,206,473.60
----------	--	---------------	---------------

### 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	9,361,568.62	6,569,959.10	15,931,527.72
二、本期期初净资产	9,361,568.62	6,569,959.10	15,931,527.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	290,876,584.68	232,504,486.98	523,381,071.66
（一）、综合收益总额	-	21,097,396.75	21,097,396.75
（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）	290,876,584.68	211,407,090.23	502,283,674.91
其中：1. 基金申购款	376,270,964.33	272,606,996.18	648,877,960.51
2. 基金赎回款	-85,394,379.65	-61,199,905.95	-146,594,285.60
（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	300,238,153.30	239,074,446.08	539,312,599.38
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	9,661,521.83	12,072,327.09	21,733,848.92
二、本期期初净资产	9,661,521.83	12,072,327.09	21,733,848.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-299,953.21	-5,502,367.99	-5,802,321.20
（一）、综合收益总额	-	-5,206,473.60	-5,206,473.60
（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）	-299,953.21	-295,894.39	-595,847.60
其中：1. 基金申购款	729,781.91	724,033.84	1,453,815.75
2. 基金赎回款	-1,029,735.12	-1,019,928.23	-2,049,663.35
（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	9,361,568.62	6,569,959.10	15,931,527.72

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《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%。

### 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 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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和托管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

(a) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(b) 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基金份额；

(c) 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%；

(d) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(e) 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基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(f) 本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；

(g) 本基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(h) 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》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。

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	38,701,388.47	892,182.10
等于：本金	38,697,915.40	892,074.07
加：应计利息	3,473.07	108.03
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	38,701,388.47	892,182.10

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	505,736,516.70	-	506,884,868.84	1,148,352.14
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	505,736,516.70	-	506,884,868.84	1,148,352.14
项目	上年度末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,872,170.15	-	14,931,289.00	59,118.85
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	14,872,170.15	-	14,931,289.00	59,118.85

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	45,973.72	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	682,702.05	154,775.16
其中：交易所市场	682,702.05	154,775.16
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	148,000.00	28,000.00
合计	876,675.77	182,775.16

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,361,568.62	9,361,568.62
本期申购	376,270,964.33	376,270,964.33
本期赎回（以“-”号填列）	-85,394,379.65	-85,394,379.65
本期末	300,238,153.30	300,238,153.30

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,111,327.28	-5,541,368.18	6,569,959.10
本期期初	12,111,327.28	-5,541,368.18	6,569,959.10
本期利润	20,008,163.46	1,089,233.29	21,097,396.75
本期基金份额交易产生的变动数	356,154,387.35	-144,747,297.12	211,407,090.23
其中：基金申购款	462,783,122.05	-190,176,125.87	272,606,996.18
基金赎回款	-106,628,734.70	45,428,828.75	-61,199,905.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	388,273,878.09	-149,199,432.01	239,074,446.08

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月	2022年01月01日至2022年12月31日

	31 日	
活期存款利息收入	20,754.43	13,060.46
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	4,350.59	2,499.77
其他	313.35	507.71
合计	25,418.37	16,067.94

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 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	257,796,736.76	223,924,398.10
减：卖出股票成本总额	235,757,833.18	227,767,493.13
减：交易费用	1,149,435.06	677,229.29
买卖股票差价收入	20,889,468.52	-4,520,324.32

#### 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 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
债券投资收益—利息收入	2,779.18	1,857.14
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-245.31	-57,917.10
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	2,533.87	-56,059.96

##### 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 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,578,069.45	3,161,693.49

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,554,696.73	3,211,602.48
减：应计利息总额	23,597.70	7,757.92
减：交易费用	20.33	250.19
买卖债券差价收入	-245.31	-57,917.10

#### 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 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	116,264.13	158,754.14
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	116,264.13	158,754.14

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	1,089,233.29	-453,825.31
--股票投资	1,089,233.29	-453,825.31
--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	1,089,233.29	-453,825.31

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	300,569.04	1,825.30
基金转换费收入	5,346.72	250.30
合计	305,915.76	2,075.60

#### 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	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	28,000.00	28,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,045.05	1,325.00
账户维护费	360.00	-
合计	149,405.05	29,325.00

#### 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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,013,170.22	277,892.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	281,211.28	75,678.05
应支付基金管理人的净管理费	731,958.94	202,214.18

注：本基金的管理费率为年费率 1.20%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2023 年 8 月 28 日前，本基金管理费率为 1.50%。本基金管理人自 2023 年 8 月 28 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为 1.20%。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	168,861.81	46,315.32

注：本基金的托管费率为年费率 0.20%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2023 年 8 月 28 日前，本基金托管费率为 0.25%。本基金管理人自 2023 年 8 月 28 日起对本基金实施调整后的基金托管费率，调整后的基金托管费率为 0.20%。

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	38,701,388.47	20,754.43	892,182.10	13,060.46

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

#### 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 2023 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
001239	永达股份	2023年12月04日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	122	1,470.10	2,430.24	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定	33.25	58.19	101	3,358.25	5,877.19	-
301459	丰茂股份	2023年12月06日	6个月	新股锁定	31.90	39.84	109	3,477.10	4,342.56	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	16.82	26.68	185	3,111.70	4,935.80	-
301516	中远通	2023年12月01日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	391	2,686.17	6,064.41	-
301526	国际	2023年	6个月	新股锁	2.66	4.45	6,003	15,967.98	26,713.35	-

	复材	12月19日		定						
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定	23.23	35.58	104	2,415.92	3,700.32	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定	11.25	11.07	209	2,351.25	2,313.63	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定	1.70	4.06	2,741	4,659.70	11,128.46	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603231	索宝蛋白	2023年12月06日	6个月	新股锁定	21.29	21.53	61	1,298.69	1,313.33	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定	28.03	49.84	113	3,167.39	5,631.92	-

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 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资(2022 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 2023 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2023 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 2023 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。本基金持有的生息资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	38,701,388.47	-	-	-	-	38,701,388.47
结算备付金	1,351,487.77	-	-	-	-	1,351,487.77
存出保证金	58,749.31	-	-	-	-	58,749.31
交易性金融资产	-	-	-	-	506,884,868.84	506,884,868.84
应收申购款	-	-	-	-	8,804,483.71	8,804,483.71
资产总计	40,111,625.55	-	-	-	515,689,352.55	555,800,978.10
负债						
应付清算款	-	-	-	-	2,665,942.90	2,665,942.90
应付赎回款	-	-	-	-	12,415,132.53	12,415,132.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	454,823.56	454,823.56
应付托管费	-	-	-	-	75,803.96	75,803.96
其他负债	-	-	-	-	876,675.77	876,675.77
负债总计	-	-	-	-	16,488,378.72	16,488,378.72
利率敏感度缺口	40,111,625.55	-	-	-	-499,200,973.83	539,312,599.38
上年度末 2022 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	892,182.10	-	-	-	-	892,182.10
结算备付金	281,000.78	-	-	-	-	281,000.78
存出保证金	23,075.48	-	-	-	-	23,075.48
交易性金融资产	-	-	-	-	14,931,289.00	14,931,289.00
应收申购款	-	-	-	-	12,910.37	12,910.37
资产总计	1,196,258.36	-	-	-	14,944,199.37	16,140,457.73
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,478.70	1,478.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	21,134.67	21,134.67
应付托管费	-	-	-	-	3,522.45	3,522.45
应交税费	-	-	-	-	19.03	19.03
其他负债	-	-	-	-	182,775.16	182,775.16
负债总计	-	-	-	-	208,930.01	208,930.01
利率敏感度缺口	1,196,258.36	-	-	-	-14,735,269.36	15,931,527.72

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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	506,884,868.84	93.99	14,931,289.00	93.72
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	506,884,868.84	93.99	14,931,289.00	93.72

##### 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(2023 年 12 月 31 日)	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	15,234,139.50	757,669.24
	业绩比较基准下降 5%	-15,234,139.50	-757,669.24

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	506,776,621.26	14,931,289.00
第二层次	-	-
第三层次	108,247.58	-
合计	506,884,868.84	14,931,289.00

###### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	63,389.37	63,389.37
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	44,858.21	44,858.21
其中：计入损益的利得或损失	-	44,858.21	44,858.21
期末余额	-	108,247.58	108,247.58
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	-	44,858.21	44,858.21
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

注：于 2023 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。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	108,247.58	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	51.41%~217.75%	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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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 (2022 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	506,884,868.84	91.20
	其中: 股票	506,884,868.84	91.20
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	40,052,876.24	7.21
8	其他各项资产	8,863,233.02	1.59

9	合计	555,800,978.10	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	3,220,784.00	0.60
B	采矿业	4,722,650.00	0.88
C	制造业	349,870,598.83	64.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,473,627.00	1.01
E	建筑业	32,225,036.20	5.98
F	批发和零售业	19,115,217.00	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	8,176,935.63	1.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,652,746.50	3.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	11,215,156.00	2.08
L	租赁和商务服务业	6,525,465.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	22,712,447.80	4.21
N	水利、环境和公共设施管理业	24,858,215.88	4.61
O	居民服务、修理和其他服务业	2,115,989.00	0.39
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	506,884,868.84	93.99

### 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	603079	圣达生物	165,500	2,411,335.00	0.45
2	002114	罗平锌电	317,100	2,371,908.00	0.44
3	002715	登云股份	145,800	2,366,334.00	0.44
4	003027	同兴环保	129,450	2,363,757.00	0.44
5	603717	天域生态	306,900	2,360,061.00	0.44

6	603356	华菱精工	161,200	2,358,356.00	0.44
7	605298	必得科技	151,200	2,357,208.00	0.44
8	002105	信隆健康	362,600	2,349,648.00	0.44
9	603268	松发股份	135,600	2,343,168.00	0.43
10	603580	艾艾精工	157,200	2,340,708.00	0.43
11	000668	荣丰控股	183,400	2,329,180.00	0.43
12	002188	中天服务	353,900	2,328,662.00	0.43
13	002836	新宏泽	265,900	2,326,625.00	0.43
14	002809	红墙股份	213,800	2,326,144.00	0.43
15	603828	柯利达	608,900	2,325,998.00	0.43
16	002718	友邦吊顶	136,700	2,325,267.00	0.43
17	001202	炬申股份	132,300	2,324,511.00	0.43
18	002295	精艺股份	284,500	2,324,365.00	0.43
19	002963	豪尔赛	149,700	2,320,350.00	0.43
20	603320	迪贝电气	145,400	2,313,314.00	0.43
21	603637	镇海股份	256,900	2,312,100.00	0.43
22	002789	建艺集团	167,800	2,308,928.00	0.43
23	003011	海象新材	108,700	2,307,701.00	0.43
24	600778	友好集团	368,800	2,305,000.00	0.43
25	002211	宏达新材	575,300	2,301,200.00	0.43
26	003001	中岩大地	127,200	2,298,504.00	0.43
27	600137	浪莎股份	125,900	2,293,898.00	0.43
28	600243	青海华鼎	480,700	2,292,939.00	0.43
29	603958	哈森股份	252,000	2,285,640.00	0.42
30	600235	民丰特纸	372,100	2,284,694.00	0.42
31	002857	三晖电气	138,300	2,281,950.00	0.42
32	603214	爱婴室	139,200	2,277,312.00	0.42
33	000590	启迪药业	253,600	2,272,256.00	0.42
34	002207	准油股份	325,200	2,269,896.00	0.42
35	002778	中晟高科	151,100	2,269,522.00	0.42
36	002826	易明医药	190,800	2,264,796.00	0.42
37	003003	天元股份	196,900	2,262,381.00	0.42
38	603159	上海亚虹	137,800	2,259,920.00	0.42
39	603616	韩建河山	403,700	2,256,683.00	0.42
40	002910	庄园牧场	206,000	2,253,640.00	0.42
41	603810	丰山集团	168,500	2,252,845.00	0.42
42	002629	仁智股份	571,700	2,252,498.00	0.42
43	001211	双枪科技	93,200	2,251,712.00	0.42
44	600448	华纺股份	681,400	2,248,620.00	0.42
45	603183	建研院	481,400	2,248,138.00	0.42
46	002144	宏达高科	192,600	2,238,012.00	0.41

47	605155	西大门	144,500	2,236,860.00	0.41
48	002278	神开股份	379,900	2,230,013.00	0.41
49	600883	博闻科技	262,300	2,229,550.00	0.41
50	605003	众望布艺	112,900	2,228,646.00	0.41
51	603506	南都物业	204,800	2,226,176.00	0.41
52	000702	正虹科技	355,000	2,225,850.00	0.41
53	000929	兰州黄河	226,500	2,219,700.00	0.41
54	600857	宁波中百	235,100	2,216,993.00	0.41
55	603709	中源家居	123,100	2,215,800.00	0.41
56	605180	华生科技	158,100	2,213,400.00	0.41
57	002830	名雕股份	148,600	2,212,654.00	0.41
58	600847	万里股份	185,500	2,211,160.00	0.41
59	600082	海泰发展	638,800	2,203,860.00	0.41
60	605069	正和生态	224,400	2,203,608.00	0.41
61	603316	诚邦股份	326,800	2,202,632.00	0.41
62	301197	工大科雅	117,000	2,198,430.00	0.41
63	002899	英派斯	132,800	2,197,840.00	0.41
64	600193	创兴资源	425,000	2,197,250.00	0.41
65	000622	恒立实业	501,500	2,196,570.00	0.41
66	300626	华瑞股份	202,200	2,193,870.00	0.41
67	600051	宁波联合	303,400	2,190,548.00	0.41
68	605287	德才股份	128,960	2,188,451.20	0.41
69	300816	艾可蓝	88,700	2,188,229.00	0.41
70	301107	瑜欣电子	68,100	2,185,329.00	0.41
71	603900	莱绅通灵	327,000	2,184,360.00	0.41
72	000608	阳光股份	758,000	2,183,040.00	0.40
73	300449	汉邦高科	324,800	2,182,656.00	0.40
74	300836	佰奥智能	76,700	2,179,814.00	0.40
75	603059	倍加洁	96,300	2,172,528.00	0.40
76	603045	福达合金	137,500	2,171,125.00	0.40
77	300912	凯龙高科	120,500	2,170,205.00	0.40
78	301125	腾亚精工	114,400	2,164,448.00	0.40
79	301163	宏德股份	79,800	2,162,580.00	0.40
80	600539	狮头股份	301,300	2,160,321.00	0.40
81	600768	宁波富邦	182,100	2,157,885.00	0.40
82	002842	翔鹭钨业	247,000	2,153,840.00	0.40
83	000605	渤海股份	336,000	2,153,760.00	0.40
84	000679	大连友谊	390,100	2,153,352.00	0.40
85	301118	恒光股份	88,100	2,152,283.00	0.40
86	300992	泰福泵业	99,500	2,147,210.00	0.40
87	301336	趣睡科技	49,000	2,145,710.00	0.40



88	300935	盈建科	78,200	2,143,462.00	0.40
89	000953	河化股份	390,700	2,137,129.00	0.40
90	300929	华骐环保	174,700	2,126,099.00	0.39
91	300956	英力股份	113,900	2,121,957.00	0.39
92	300658	延江股份	313,000	2,119,010.00	0.39
93	300736	百邦科技	165,700	2,115,989.00	0.39
94	002231	奥维通信	322,800	2,107,884.00	0.39
95	300521	爱司凯	152,100	2,106,585.00	0.39
96	300535	达威股份	120,300	2,106,453.00	0.39
97	300971	博亚精工	84,500	2,104,050.00	0.39
98	300849	锦盛新材	158,800	2,102,512.00	0.39
99	300594	朗进科技	100,600	2,100,528.00	0.39
100	300509	新美星	290,200	2,098,146.00	0.39
101	001231	农心科技	100,700	2,097,581.00	0.39
102	301040	中环海陆	110,500	2,096,185.00	0.39
103	301049	超越科技	90,500	2,095,980.00	0.39
104	300907	康平科技	94,400	2,094,736.00	0.39
105	603041	美思德	155,400	2,091,684.00	0.39
106	300417	南华仪器	166,600	2,090,830.00	0.39
107	301024	霍普股份	69,000	2,090,700.00	0.39
108	301079	邵阳液压	120,700	2,088,110.00	0.39
109	300665	飞鹿股份	241,500	2,086,560.00	0.39
110	301192	泰祥股份	90,600	2,080,176.00	0.39
111	300897	山科智能	60,800	2,079,360.00	0.39
112	600156	华升股份	422,200	2,077,224.00	0.39
113	301300	远翔新材	65,584	2,074,421.92	0.38
114	300270	中威电子	268,400	2,072,048.00	0.38
115	300923	研奥股份	84,400	2,069,488.00	0.38
116	301228	实朴检测	124,500	2,064,210.00	0.38
117	301288	清研环境	108,729	2,063,676.42	0.38
118	300845	捷安高科	114,200	2,063,594.00	0.38
119	300610	晨化股份	182,900	2,061,283.00	0.38
120	300103	达刚控股	324,400	2,059,940.00	0.38
121	301043	绿岛风	62,900	2,058,717.00	0.38
122	000573	粤宏远 A	609,000	2,058,420.00	0.38
123	300877	金春股份	118,900	2,058,159.00	0.38
124	600493	凤竹纺织	304,650	2,047,248.00	0.38
125	301023	江南奕帆	49,300	2,045,950.00	0.38
126	605303	园林股份	167,600	2,044,720.00	0.38
127	300717	华信新材	121,700	2,043,343.00	0.38
128	300838	浙江力诺	124,800	2,041,728.00	0.38

129	300321	同大股份	105,400	2,039,490.00	0.38
130	301167	建研设计	120,500	2,038,860.00	0.38
131	301156	美农生物	108,000	2,036,880.00	0.38
132	301037	保立佳	102,060	2,034,055.80	0.38
133	300947	德必集团	129,600	2,033,424.00	0.38
134	301008	宏昌科技	67,300	2,031,787.00	0.38
135	301036	双乐股份	91,600	2,030,772.00	0.38
136	300960	通业科技	91,500	2,029,470.00	0.38
137	300243	瑞丰高材	207,700	2,029,229.00	0.38
138	300635	中达安	161,200	2,027,896.00	0.38
139	300823	建科机械	94,200	2,026,242.00	0.38
140	300743	天地数码	145,900	2,025,092.00	0.38
141	300961	深水海纳	180,300	2,024,769.00	0.38
142	300675	建科院	133,500	2,022,525.00	0.38
143	300871	回盛生物	139,800	2,021,508.00	0.37
144	003023	彩虹集团	99,600	2,017,896.00	0.37
145	300931	通用电梯	238,900	2,016,316.00	0.37
146	300334	津膜科技	260,300	2,014,722.00	0.37
147	300970	华绿生物	116,300	2,007,338.00	0.37
148	300689	澄天伟业	103,200	1,998,984.00	0.37
149	300640	德艺文创	311,100	1,997,262.00	0.37
150	300948	冠中生态	138,600	1,997,226.00	0.37
151	301209	联合化学	80,000	1,996,800.00	0.37
152	300649	杭州园林	119,100	1,994,925.00	0.37
153	600421	华嵘控股	179,200	1,994,496.00	0.37
154	300865	大宏立	88,800	1,993,560.00	0.37
155	301198	喜悦智行	164,200	1,993,388.00	0.37
156	300753	爱朋医疗	116,000	1,991,720.00	0.37
157	301027	华蓝集团	159,100	1,990,341.00	0.37
158	301233	盛帮股份	44,800	1,990,016.00	0.37
159	300899	上海凯鑫	73,200	1,989,576.00	0.37
160	301010	晶雪节能	106,300	1,986,747.00	0.37
161	301053	远信工业	71,300	1,986,418.00	0.37
162	300920	润阳科技	94,200	1,982,910.00	0.37
163	301055	张小泉	137,500	1,982,750.00	0.37
164	301234	五洲医疗	58,400	1,978,592.00	0.37
165	301098	金埔园林	167,100	1,973,451.00	0.37
166	300854	中兰环保	113,000	1,971,850.00	0.37
167	300703	创源股份	175,100	1,968,124.00	0.36
168	300746	汉嘉设计	195,700	1,966,785.00	0.36
169	600202	哈空调	314,100	1,959,984.00	0.36

170	300749	顶固集创	211,400	1,959,678.00	0.36
171	300329	海伦钢琴	262,400	1,954,880.00	0.36
172	301113	雅艺科技	60,500	1,952,335.00	0.36
173	300385	雪浪环境	290,500	1,952,160.00	0.36
174	301161	唯万密封	96,100	1,943,142.00	0.36
175	300564	筑博设计	144,000	1,938,240.00	0.36
176	600793	宜宾纸业	166,400	1,933,568.00	0.36
177	300995	奇德新材	90,900	1,933,443.00	0.36
178	301178	天亿马	59,400	1,926,342.00	0.36
179	603329	上海雅仕	120,700	1,923,958.00	0.36
180	300906	日月明	76,000	1,922,040.00	0.36
181	300819	聚杰微纤	123,400	1,918,870.00	0.36
182	301130	西点药业	68,200	1,901,416.00	0.35
183	301182	凯旺科技	81,200	1,898,456.00	0.35
184	003017	大洋生物	77,440	1,883,340.80	0.35
185	301081	严牌股份	169,200	1,878,120.00	0.35
186	002209	达意隆	170,300	1,873,300.00	0.35
187	301273	瑞晨环保	67,800	1,870,602.00	0.35
188	002883	中设股份	152,300	1,870,244.00	0.35
189	002890	弘宇股份	119,400	1,844,730.00	0.34
190	301065	本立科技	79,900	1,817,725.00	0.34
191	600356	恒丰纸业	226,100	1,804,278.00	0.33
192	300955	嘉亨家化	81,500	1,801,965.00	0.33
193	301032	新柴股份	171,300	1,735,269.00	0.32
194	603955	大千生态	117,700	1,729,013.00	0.32
195	300886	华业香料	68,200	1,689,314.00	0.31
196	301001	凯淳股份	66,100	1,688,194.00	0.31
197	002357	富临运业	217,600	1,642,880.00	0.30
198	300808	久量股份	102,600	1,598,508.00	0.30
199	600969	郴电国际	245,900	1,598,350.00	0.30
200	301057	汇隆新材	95,100	1,597,680.00	0.30
201	603269	海鸥股份	117,100	1,577,337.00	0.29
202	300621	维业股份	136,900	1,572,981.00	0.29
203	001336	楚环科技	52,600	1,510,672.00	0.28
204	301022	海泰科	55,000	1,500,400.00	0.28
205	603822	嘉澳环保	53,900	1,498,959.00	0.28
206	603657	春光科技	93,100	1,497,979.00	0.28
207	600791	京能置业	305,300	1,483,758.00	0.28
208	001210	金房能源	73,500	1,451,625.00	0.27
209	002780	三夫户外	113,000	1,413,630.00	0.26
210	600319	亚星化学	238,300	1,377,374.00	0.26

211	603813	原尚股份	83,100	1,342,065.00	0.25
212	002205	国统股份	122,700	1,328,841.00	0.25
213	300721	怡达股份	86,300	1,288,459.00	0.24
214	301063	海锅股份	55,900	1,274,520.00	0.24
215	300950	德固特	78,900	1,272,657.00	0.24
216	603226	菲林格尔	179,300	1,247,928.00	0.23
217	600538	国发股份	265,800	1,233,312.00	0.23
218	605033	美邦股份	68,400	1,227,780.00	0.23
219	001259	利仁科技	43,100	1,220,592.00	0.23
220	002696	百洋股份	183,300	1,213,446.00	0.22
221	300644	南京聚隆	58,200	1,207,650.00	0.22
222	300984	金沃股份	42,200	1,179,912.00	0.22
223	300810	中科海讯	56,900	1,160,760.00	0.22
224	603655	朗博科技	54,800	1,140,936.00	0.21
225	300789	唐源电气	50,300	1,133,762.00	0.21
226	605255	天普股份	64,100	1,124,955.00	0.21
227	603022	新通联	107,700	1,109,310.00	0.21
228	300262	巴安水务	340,000	1,108,400.00	0.21
229	600802	福建水泥	208,400	1,079,512.00	0.20
230	000638	万方发展	157,600	1,059,072.00	0.20
231	300611	美力科技	87,400	1,004,226.00	0.19
232	300605	恒锋信息	67,000	1,002,990.00	0.19
233	300387	富邦股份	119,700	998,298.00	0.19
234	300930	屹通新材	41,300	987,896.00	0.18
235	603829	洛凯股份	60,100	981,433.00	0.18
236	688109	品茗科技	34,300	966,231.00	0.18
237	603021	山东华鹏	146,300	964,117.00	0.18
238	688090	瑞松科技	29,500	955,505.00	0.18
239	300405	科隆股份	145,400	939,284.00	0.17
240	000632	三木集团	205,000	936,850.00	0.17
241	002377	国创高新	369,400	934,582.00	0.17
242	688655	迅捷兴	60,200	909,020.00	0.17
243	002760	凤形股份	41,300	905,296.00	0.17
244	688659	元琛科技	72,700	905,115.00	0.17
245	688616	西力科技	65,900	898,876.00	0.17
246	688607	康众医疗	44,000	896,720.00	0.17
247	301003	江苏博云	35,600	888,576.00	0.16
248	688081	兴图新科	51,600	888,036.00	0.16
249	300515	三德科技	76,200	879,348.00	0.16
250	300901	中胤时尚	85,700	877,568.00	0.16
251	003008	开普检测	31,100	868,001.00	0.16

252	688067	爱威科技	36,300	864,303.00	0.16
253	605318	法狮龙	53,700	862,959.00	0.16
254	300462	华铭智能	73,100	861,849.00	0.16
255	688092	爱科科技	27,900	858,204.00	0.16
256	603838	四通股份	118,400	852,480.00	0.16
257	688597	煜邦电力	91,900	836,290.00	0.16
258	300670	大烨智能	106,200	831,546.00	0.15
259	688021	奥福环保	39,700	827,745.00	0.15
260	688217	睿昂基因	22,100	790,738.00	0.15
261	000985	大庆华科	48,800	789,584.00	0.15
262	301068	大地海洋	25,200	766,080.00	0.14
263	688379	华光新材	37,800	747,306.00	0.14
264	300844	山水比德	20,400	704,004.00	0.13
265	688329	艾隆科技	28,100	698,566.00	0.13
266	688171	纬德信息	30,601	688,522.50	0.13
267	688163	赛伦生物	34,400	687,656.00	0.13
268	603221	爱丽家居	69,100	686,854.00	0.13
269	688681	科汇股份	44,134	681,870.30	0.13
270	002820	桂发祥	58,900	672,638.00	0.12
271	600561	江西长运	103,500	664,470.00	0.12
272	688013	天臣医疗	31,400	662,540.00	0.12
273	301226	祥明智能	27,200	620,976.00	0.12
274	003041	真爱美家	37,200	619,380.00	0.11
275	688350	富淼科技	36,428	602,154.84	0.11
276	600232	金鹰股份	96,900	587,214.00	0.11
277	688395	正弦电气	25,000	574,750.00	0.11
278	300371	汇中股份	46,300	564,397.00	0.10
279	603499	翔港科技	52,100	560,596.00	0.10
280	688669	聚石化学	29,400	550,956.00	0.10
281	605258	协和电子	17,000	472,090.00	0.09
282	688178	万德斯	25,986	469,826.88	0.09
283	603272	联翔股份	27,800	469,264.00	0.09
284	301075	多瑞医药	16,400	437,388.00	0.08
285	002513	蓝丰生化	62,700	433,884.00	0.08
286	000004	国华网安	24,100	388,733.00	0.07
287	300710	万隆光电	12,300	299,136.00	0.06
288	002492	恒基达鑫	46,200	276,738.00	0.05
289	603182	嘉华股份	18,700	276,199.00	0.05
290	603080	新疆火炬	16,200	269,892.00	0.05
291	002871	伟隆股份	23,900	267,202.00	0.05
292	301002	崧盛股份	12,800	265,472.00	0.05

293	688227	品高股份	12,200	232,654.00	0.04
294	300883	龙利得	30,200	221,970.00	0.04
295	002719	麦趣尔	18,000	208,440.00	0.04
296	300876	蒙泰高新	8,300	207,666.00	0.04
297	301237	和顺科技	6,800	207,196.00	0.04
298	000695	滨海能源	19,000	205,390.00	0.04
299	002828	贝肯能源	19,200	200,256.00	0.04
300	002802	洪汇新材	15,600	199,836.00	0.04
301	605178	时空科技	6,600	183,018.00	0.03
302	688215	瑞晟智能	4,928	177,161.60	0.03
303	603608	天创时尚	27,700	155,397.00	0.03
304	301158	德石股份	9,400	151,246.00	0.03
305	688251	井松智能	3,300	95,964.00	0.02
306	002921	联诚精密	5,800	94,946.00	0.02
307	688466	金科环境	5,000	88,750.00	0.02
308	603161	科华控股	5,500	87,890.00	0.02
309	688367	工大高科	2,800	49,952.00	0.01
310	688096	京源环保	5,300	49,661.00	0.01
311	301526	国际复材	6,003	26,713.35	0.00
312	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
313	601096	宏盛华源	2,741	11,128.46	0.00
314	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
315	603004	鼎龙科技	248	7,990.05	0.00
316	301516	中远通	391	6,064.41	0.00
317	301413	安培龙	101	5,877.19	0.00
318	688720	艾森股份	113	5,631.92	0.00
319	301508	中机认检	185	4,935.80	0.00
320	301459	丰茂股份	109	4,342.56	0.00
321	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
322	301568	思泰克	104	3,700.32	0.00
323	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
324	001239	永达股份	122	2,430.24	0.00
325	601083	锦江航运	209	2,313.63	0.00
326	603231	索宝蛋白	61	1,313.33	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	300665	飞鹿股份	3,955,207.00	24.83

2	600768	宁波富邦	3,709,015.00	23.28
3	300929	华骐环保	3,613,847.80	22.68
4	603580	艾艾精工	3,235,566.00	20.31
5	600137	浪莎股份	3,209,627.00	20.15
6	603320	迪贝电气	3,149,117.00	19.77
7	002778	中晟高科	3,051,861.00	19.16
8	603958	哈森股份	3,048,392.00	19.13
9	603717	天域生态	3,015,683.00	18.93
10	000573	粤宏远 A	3,000,348.00	18.83
11	002836	新宏泽	2,983,454.80	18.73
12	300321	同大股份	2,982,095.00	18.72
13	301228	实朴检测	2,962,031.27	18.59
14	603226	菲林格尔	2,959,174.20	18.57
15	603616	韩建河山	2,933,492.00	18.41
16	603316	诚邦股份	2,926,472.00	18.37
17	001211	双枪科技	2,925,209.00	18.36
18	605298	必得科技	2,918,661.42	18.32
19	300594	朗进科技	2,875,600.00	18.05
20	300816	艾可蓝	2,856,124.00	17.93
21	003001	中岩大地	2,850,973.00	17.90
22	301113	雅艺科技	2,848,408.00	17.88
23	605003	众望布艺	2,844,929.00	17.86
24	603332	苏州龙杰	2,821,304.20	17.71
25	600193	创兴资源	2,812,384.00	17.65
26	301049	超越科技	2,753,989.00	17.29
27	300845	捷安高科	2,749,154.00	17.26
28	300992	泰福泵业	2,745,236.00	17.23
29	300920	润阳科技	2,742,105.00	17.21
30	300836	佰奥智能	2,737,028.00	17.18
31	301233	盛帮股份	2,735,058.00	17.17
32	301125	腾亚精工	2,705,757.20	16.98
33	600243	青海华鼎	2,693,444.00	16.91
34	300753	爱朋医疗	2,684,736.00	16.85
35	301079	邵阳液压	2,668,674.00	16.75
36	603079	圣达生物	2,663,393.00	16.72
37	301040	中环海陆	2,653,532.00	16.66
38	603810	丰山集团	2,632,330.16	16.52
39	002963	豪尔赛	2,632,281.00	16.52
40	300334	津膜科技	2,624,243.00	16.47
41	002826	易明医药	2,616,857.63	16.43
42	300243	瑞丰高材	2,616,593.00	16.42

43	600051	宁波联合	2,613,878.00	16.41
44	300823	建科机械	2,613,632.00	16.41
45	600493	凤竹纺织	2,610,778.50	16.39
46	603900	莱绅通灵	2,600,531.00	16.32
47	301209	联合化学	2,589,879.00	16.26
48	300956	英力股份	2,571,862.00	16.14
49	603159	上海亚虹	2,569,453.40	16.13
50	000679	大连友谊	2,561,593.00	16.08
51	000590	启迪药业	2,559,958.00	16.07
52	603329	上海雅仕	2,547,393.00	15.99
53	001202	炬申股份	2,541,706.00	15.95
54	301081	严牌股份	2,539,760.40	15.94
55	002715	登云股份	2,529,687.00	15.88
56	605303	园林股份	2,523,512.00	15.84
57	002629	仁智股份	2,522,334.10	15.83
58	002830	名雕股份	2,508,615.00	15.75
59	603828	柯利达	2,503,057.00	15.71
60	002789	建艺集团	2,494,222.00	15.66
61	300658	延江股份	2,489,474.02	15.63
62	002809	红墙股份	2,485,070.50	15.60
63	002857	三晖电气	2,479,232.00	15.56
64	603183	建研院	2,476,352.00	15.54
65	300736	百邦科技	2,468,718.00	15.50
66	300970	华绿生物	2,467,571.00	15.49
67	300819	聚杰微纤	2,464,746.00	15.47
68	002207	准油股份	2,448,720.00	15.37
69	300971	博亚精工	2,433,074.44	15.27
70	000929	兰州黄河	2,430,080.00	15.25
71	002718	友邦吊顶	2,429,859.00	15.25
72	300743	天地数码	2,427,093.00	15.23
73	603506	南都物业	2,424,604.00	15.22
74	300564	筑博设计	2,422,989.80	15.21
75	003011	海象新材	2,422,757.00	15.21
76	002105	信隆健康	2,410,335.00	15.13
77	300270	中威电子	2,409,921.00	15.13
78	002910	庄园牧场	2,409,128.00	15.12
79	301197	工大科雅	2,398,746.00	15.06
80	003027	同兴环保	2,396,841.00	15.04
81	003023	彩虹集团	2,394,740.00	15.03
82	603268	松发股份	2,392,784.00	15.02
83	002188	中天服务	2,392,087.60	15.01



84	000622	恒立实业	2,388,905.00	14.99
85	300417	南华仪器	2,386,446.00	14.98
86	605155	西大门	2,383,138.60	14.96
87	600156	华升股份	2,380,483.00	14.94
88	301037	保立佳	2,378,779.20	14.93
89	300948	冠中生态	2,372,812.00	14.89
90	600778	友好集团	2,371,985.00	14.89
91	300935	盈建科	2,371,165.00	14.88
92	603709	中源家居	2,368,801.20	14.87
93	000856	冀东装备	2,368,378.00	14.87
94	603214	爱婴室	2,368,309.00	14.87
95	300955	嘉亨家化	2,364,052.00	14.84
96	603059	倍加洁	2,362,248.00	14.83
97	000953	河化股份	2,362,116.19	14.83
98	002211	宏达新材	2,361,320.00	14.82
99	300535	达威股份	2,359,763.00	14.81
100	003003	天元股份	2,357,695.40	14.80
101	002144	宏达高科	2,355,169.00	14.78
102	002114	罗平锌电	2,347,143.00	14.73
103	600448	华纺股份	2,345,020.00	14.72
104	300960	通业科技	2,342,324.00	14.70
105	002278	神开股份	2,339,777.00	14.69
106	603637	镇海股份	2,336,622.00	14.67
107	301288	清研环境	2,336,231.67	14.66
108	600235	民丰特纸	2,333,033.00	14.64
109	603188	亚邦股份	2,331,805.00	14.64
110	301163	宏德股份	2,330,534.00	14.63
111	300877	金春股份	2,325,651.00	14.60
112	000608	阳光股份	2,314,418.00	14.53
113	301156	美农生物	2,314,347.60	14.53
114	300262	巴安水务	2,314,224.00	14.53
115	000702	正虹科技	2,313,821.00	14.52
116	300749	顶固集创	2,311,854.00	14.51
117	605287	德才股份	2,311,135.00	14.51
118	001231	农心科技	2,308,668.00	14.49
119	600082	海泰发展	2,308,103.00	14.49
120	600857	宁波中百	2,303,479.00	14.46
121	301107	瑜欣电子	2,301,692.00	14.45
122	300635	中达安	2,300,047.00	14.44
123	002295	精艺股份	2,298,461.00	14.43
124	301098	金埔园林	2,297,137.97	14.42

125	600883	博闻科技	2,297,051.00	14.42
126	603356	华菱精工	2,290,550.00	14.38
127	605069	正和生态	2,290,476.00	14.38
128	000668	荣丰控股	2,285,532.00	14.35
129	000619	海螺新材	2,284,958.00	14.34
130	301336	趣睡科技	2,282,823.00	14.33
131	002890	弘宇股份	2,278,873.19	14.30
132	603041	美思德	2,275,250.00	14.28
133	002899	英派斯	2,272,872.00	14.27
134	300961	深水海纳	2,272,097.00	14.26
135	301178	天亿马	2,271,394.00	14.26
136	300521	爱司凯	2,265,505.00	14.22
137	603045	福达合金	2,262,757.00	14.20
138	600539	狮头股份	2,259,456.00	14.18
139	002205	国统股份	2,257,775.00	14.17
140	002842	翔鹭钨业	2,253,896.00	14.15
141	300897	山科智能	2,253,509.23	14.14
142	300912	凯龙高科	2,253,238.00	14.14
143	300854	中兰环保	2,251,755.00	14.13
144	300808	久量股份	2,247,922.00	14.11
145	600847	万里股份	2,246,716.00	14.10
146	300906	日月明	2,246,213.00	14.10
147	002357	富临运业	2,238,924.00	14.05
148	300865	大宏立	2,235,089.00	14.03
149	605180	华生科技	2,233,598.94	14.02
150	300899	上海凯鑫	2,231,658.93	14.01
151	301234	五洲医疗	2,219,926.00	13.93
152	301198	喜悦智行	2,213,705.00	13.90
153	300103	达刚控股	2,213,688.00	13.90
154	300689	澄天伟业	2,210,653.00	13.88
155	300649	杭州园林	2,202,388.00	13.82
156	301036	双乐股份	2,199,204.00	13.80
157	300995	奇德新材	2,198,442.00	13.80
158	000605	渤海股份	2,196,572.00	13.79
159	603657	春光科技	2,193,231.00	13.77
160	300717	华信新材	2,190,839.43	13.75
161	300886	华业香料	2,187,615.00	13.73
162	300907	康平科技	2,186,201.00	13.72
163	300923	研奥股份	2,179,627.00	13.68
164	301192	泰祥股份	2,178,717.00	13.68
165	600202	哈空调	2,178,381.00	13.67

166	301024	霍普股份	2,177,536.40	13.67
167	000632	三木集团	2,177,131.00	13.67
168	300387	富邦股份	2,175,327.00	13.65
169	300838	浙江力诺	2,173,672.00	13.64
170	301300	远翔新材	2,168,883.20	13.61
171	002231	奥维通信	2,166,354.00	13.60
172	301167	建研设计	2,162,927.00	13.58
173	600793	宜宾纸业	2,158,463.00	13.55
174	300610	晨化股份	2,151,376.00	13.50
175	300509	新美星	2,147,160.00	13.48
176	301010	晶雪节能	2,144,097.46	13.46
177	300644	南京聚隆	2,142,736.70	13.45
178	300626	华瑞股份	2,128,566.00	13.36
179	301055	张小泉	2,125,643.00	13.34
180	301043	绿岛风	2,122,422.00	13.32
181	300849	锦盛新材	2,119,020.00	13.30
182	301027	华蓝集团	2,114,829.00	13.27
183	301008	宏昌科技	2,111,310.00	13.25
184	603269	海鸥股份	2,109,609.00	13.24
185	301023	江南奕帆	2,089,999.00	13.12
186	300931	通用电梯	2,088,192.80	13.11
187	001336	楚环科技	2,087,228.00	13.10
188	300947	德必集团	2,085,161.00	13.09
189	300746	汉嘉设计	2,082,688.00	13.07
190	603021	山东华鹏	2,070,953.00	13.00
191	300675	建科院	2,069,431.00	12.99
192	301130	西点药业	2,067,871.00	12.98
193	300640	德艺文创	2,054,221.00	12.89
194	300449	汉邦高科	2,046,646.00	12.85
195	301182	凯旺科技	2,040,714.00	12.81
196	301273	瑞晨环保	2,017,625.42	12.66
197	300871	回盛生物	2,000,038.00	12.55
198	301161	唯万密封	1,998,366.00	12.54
199	300329	海伦钢琴	1,993,079.00	12.51
200	603955	大千生态	1,993,064.00	12.51
201	300385	雪浪环境	1,992,254.72	12.51
202	301053	远信工业	1,987,828.00	12.48
203	600356	恒丰纸业	1,986,465.00	12.47
204	300703	创源股份	1,978,908.75	12.42
205	301118	恒光股份	1,952,845.00	12.26
206	600421	华嵘控股	1,918,550.00	12.04

207	603838	四通股份	1,916,548.00	12.03
208	002883	中设股份	1,907,816.00	11.98
209	002209	达意隆	1,888,097.00	11.85
210	300405	科隆股份	1,882,912.00	11.82
211	003017	大洋生物	1,878,561.20	11.79
212	301032	新柴股份	1,871,538.00	11.75
213	301001	凯淳股份	1,860,625.00	11.68
214	603813	原尚股份	1,850,739.00	11.62
215	000890	法尔胜	1,849,454.00	11.61
216	301131	聚赛龙	1,830,517.00	11.49
217	600234	科新发展	1,816,368.00	11.40
218	301065	本立科技	1,810,456.00	11.36
219	605255	天普股份	1,808,662.00	11.35
220	002862	实丰文化	1,774,271.00	11.14
221	300621	维业股份	1,772,397.00	11.13
222	603822	嘉澳环保	1,765,816.00	11.08
223	301057	汇隆新材	1,760,869.00	11.05
224	600319	亚星化学	1,759,763.00	11.05
225	603389	亚振家居	1,752,841.00	11.00
226	300462	华铭智能	1,743,541.00	10.94
227	600969	郴电国际	1,700,847.00	10.68
228	600149	廊坊发展	1,670,591.00	10.49
229	600232	金鹰股份	1,600,801.00	10.05
230	605178	时空科技	1,597,816.00	10.03
231	603789	星光农机	1,597,758.00	10.03
232	001210	金房能源	1,583,030.00	9.94
233	300984	金沃股份	1,580,741.00	9.92
234	002199	东晶电子	1,567,792.00	9.84
235	001209	洪兴股份	1,545,194.00	9.70
236	600697	欧亚集团	1,542,571.00	9.68
237	000638	万方发展	1,537,557.00	9.65
238	600678	四川金顶	1,535,335.00	9.64
239	603696	安记食品	1,532,478.00	9.62
240	002494	华斯股份	1,524,256.00	9.57
241	600444	国机通用	1,519,290.00	9.54
242	600791	京能置业	1,511,121.00	9.49
243	002780	三夫户外	1,505,343.00	9.45
244	301022	海泰科	1,501,010.00	9.42
245	600083	博信股份	1,500,212.00	9.42
246	600128	苏豪弘业	1,462,708.00	9.18
247	600099	林海股份	1,459,672.00	9.16

248	688681	科汇股份	1,435,985.79	9.01
249	688067	爱威科技	1,428,472.26	8.97
250	002696	百洋股份	1,424,738.30	8.94
251	688669	聚石化学	1,405,036.15	8.82
252	002767	先锋电子	1,381,457.00	8.67
253	600889	南京化纤	1,372,139.92	8.61
254	603725	天安新材	1,364,059.92	8.56
255	603860	中公高科	1,359,325.00	8.53
256	001259	利仁科技	1,327,610.00	8.33
257	002304	洋河股份	1,316,275.00	8.26
258	600538	国发股份	1,304,773.00	8.19
259	301231	荣信文化	1,290,352.00	8.10
260	300949	奥雅股份	1,288,487.00	8.09
261	688178	万德斯	1,281,456.24	8.04
262	002691	冀凯股份	1,254,009.00	7.87
263	300950	德固特	1,251,397.00	7.85
264	300721	怡达股份	1,250,273.00	7.85
265	600561	江西长运	1,244,298.12	7.81
266	301063	海锅股份	1,237,969.73	7.77
267	603499	翔港科技	1,235,640.00	7.76
268	603392	万泰生物	1,234,332.00	7.75
269	600455	博通股份	1,233,094.00	7.74
270	688597	煜邦电力	1,217,862.48	7.64
271	688081	兴图新科	1,211,609.79	7.61
272	003004	声迅股份	1,203,720.00	7.56
273	605033	美邦股份	1,199,398.00	7.53
274	688021	奥福环保	1,194,202.68	7.50
275	300883	龙利得	1,189,867.00	7.47
276	600689	上海三毛	1,187,462.00	7.45
277	300789	唐源电气	1,184,563.00	7.44
278	605318	法狮龙	1,184,209.00	7.43
279	600802	福建水泥	1,177,371.00	7.39
280	002058	威尔泰	1,170,193.00	7.35
281	603536	惠发食品	1,168,935.21	7.34
282	600097	开创国际	1,159,778.00	7.28
283	300611	美力科技	1,158,015.00	7.27
284	688109	品茗科技	1,151,866.58	7.23
285	300810	中科海讯	1,150,296.00	7.22
286	603655	朗博科技	1,137,995.00	7.14
287	603022	新通联	1,129,256.00	7.09
288	688395	正弦电气	1,119,700.24	7.03

289	002806	华锋股份	1,104,309.00	6.93
290	603038	华立股份	1,079,254.00	6.77
291	688379	华光新材	1,076,433.70	6.76
292	688616	西力科技	1,074,071.87	6.74
293	603608	天创时尚	1,062,263.00	6.67
294	002856	美芝股份	1,059,497.00	6.65
295	600250	南京商旅	1,052,434.00	6.61
296	600593	大连圣亚	1,039,663.00	6.53
297	603721	中广天择	1,022,721.00	6.42
298	603272	联翔股份	1,015,652.00	6.38
299	600241	时代万恒	1,009,837.00	6.34
300	603221	爱丽家居	999,396.00	6.27
301	688171	纬德信息	996,605.43	6.26
302	000661	长春高新	996,060.00	6.25
303	300605	恒锋信息	993,845.00	6.24
304	300930	屹通新材	990,798.27	6.22
305	601117	中国化学	982,469.00	6.17
306	603829	洛凯股份	978,373.00	6.14
307	002861	瀛通通讯	973,808.60	6.11
308	688004	博汇科技	963,344.64	6.05
309	688296	和达科技	959,475.32	6.02
310	300515	三德科技	951,206.00	5.97
311	002377	国创高新	934,404.00	5.87
312	688215	瑞晟智能	927,142.40	5.82
313	688659	元琛科技	924,498.86	5.80
314	688038	中科通达	922,967.62	5.79
315	688655	迅捷兴	918,559.50	5.77
316	688090	瑞松科技	912,678.97	5.73
317	688607	康众医疗	909,186.23	5.71
318	600057	厦门象屿	905,792.00	5.69
319	002760	凤形股份	904,936.00	5.68
320	603090	宏盛股份	892,671.00	5.60
321	688092	爱科科技	888,788.51	5.58
322	688217	睿昂基因	888,407.53	5.58
323	003008	开普检测	887,759.00	5.57
324	000985	大庆华科	884,042.00	5.55
325	600506	统一股份	870,566.00	5.46
326	688350	富淼科技	868,611.27	5.45
327	301003	江苏博云	859,449.00	5.39
328	688335	复洁环保	854,795.54	5.37
329	300901	中胤时尚	852,145.00	5.35

330	301208	中亦科技	850,983.00	5.34
331	002591	恒大高新	846,939.00	5.32
332	002893	京能热力	839,496.00	5.27
333	600712	南宁百货	832,459.00	5.23
334	300601	康泰生物	803,660.00	5.04
335	300670	大烨智能	800,389.00	5.02
336	600281	华阳新材	799,399.00	5.02
337	300254	仟源医药	794,444.00	4.99
338	603707	健友股份	790,119.00	4.96
339	000739	普洛药业	790,026.00	4.96
340	688329	艾隆科技	789,260.63	4.95
341	688251	井松智能	784,818.39	4.93
342	600809	山西汾酒	781,864.00	4.91
343	688163	赛伦生物	769,354.06	4.83
344	301068	大地海洋	765,536.00	4.81
345	000425	徐工机械	750,358.00	4.71
346	301067	显盈科技	742,414.00	4.66
347	688685	迈信林	742,129.68	4.66
348	688013	天臣医疗	738,568.37	4.64
349	300844	山水比德	736,695.17	4.62
350	002180	纳思达	736,182.00	4.62
351	603385	惠达卫浴	721,285.40	4.53
352	002727	一心堂	711,818.72	4.47
353	002555	三七互娱	706,981.00	4.44
354	688393	安必平	705,345.39	4.43
355	688260	昀冢科技	691,301.88	4.34
356	002719	麦趣尔	680,904.00	4.27
357	605258	协和电子	679,238.00	4.26
358	002987	京北方	678,294.00	4.26
359	002898	赛隆药业	670,371.00	4.21
360	002820	桂发祥	668,637.00	4.20
361	605266	健之佳	666,039.00	4.18
362	003041	真爱美家	652,695.00	4.10
363	301075	多瑞医药	650,880.00	4.09
364	002802	洪汇新材	637,579.00	4.00
365	301071	力量钻石	633,695.00	3.98
366	300630	普利制药	608,745.00	3.82
367	301226	祥明智能	596,712.00	3.75
368	603029	天鹅股份	596,356.00	3.74
369	688096	京源环保	589,501.82	3.70
370	688235	百济神州	579,479.96	3.64

371	603036	如通股份	569,129.00	3.57
372	600755	厦门国贸	566,916.00	3.56
373	002888	惠威科技	565,653.00	3.55
374	300725	药石科技	564,502.00	3.54
375	600692	亚通股份	557,513.00	3.50
376	300371	汇中股份	552,136.00	3.47
377	603286	日盈电子	544,010.00	3.41
378	600582	天地科技	540,823.00	3.39
379	300242	佳云科技	534,786.00	3.36
380	688367	工大高科	532,788.70	3.34
381	600926	杭州银行	530,975.00	3.33
382	603080	新疆火炬	517,728.00	3.25
383	300980	祥源新材	510,988.00	3.21
384	688115	思林杰	502,863.15	3.16
385	688501	青达环保	496,983.08	3.12
386	688679	通源环境	496,879.61	3.12
387	600009	上海机场	492,448.00	3.09
388	002050	三花智控	490,289.00	3.08
389	603729	龙韵股份	485,640.00	3.05
390	300554	三超新材	480,398.00	3.02
391	688517	金冠电气	479,953.51	3.01
392	603615	茶花股份	476,792.00	2.99
393	688328	深科达	473,260.44	2.97
394	600882	妙可蓝多	467,629.00	2.94
395	000977	浪潮信息	462,730.00	2.90
396	603037	凯众股份	460,646.00	2.89
397	688687	凯因科技	459,916.89	2.89
398	002921	联诚精密	459,522.00	2.88
399	603089	正裕工业	457,080.00	2.87
400	688229	博睿数据	449,955.99	2.82
401	688129	东来技术	439,230.16	2.76
402	002828	贝肯能源	430,749.00	2.70
403	688118	普元信息	428,715.34	2.69
404	300911	亿田智能	408,277.00	2.56
405	002513	蓝丰生化	404,881.00	2.54
406	000004	国华网安	401,211.00	2.52
407	002049	紫光国微	393,502.00	2.47
408	002492	恒基达鑫	381,267.00	2.39
409	603444	吉比特	377,300.00	2.37
410	300781	因赛集团	353,986.00	2.22
411	300391	长药控股	353,851.00	2.22



412	002271	东方雨虹	335,751.00	2.11
413	300210	森远股份	326,844.00	2.05
414	600761	安徽合力	322,934.00	2.03
415	688466	金科环境	320,953.35	2.01
416	688237	超卓航科	320,491.56	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	603332	苏州龙杰	3,420,449.00	21.47
2	600678	四川金顶	2,753,733.00	17.28
3	603789	星光农机	2,672,262.20	16.77
4	000856	冀东装备	2,585,099.00	16.23
5	000619	海螺新材	2,535,275.00	15.91
6	603188	亚邦股份	2,495,166.00	15.66
7	002862	实丰文化	2,315,187.00	14.53
8	300949	奥雅股份	2,212,992.00	13.89
9	603389	亚振家居	2,192,055.00	13.76
10	600250	南京商旅	2,184,061.00	13.71
11	600234	科新发展	2,163,418.00	13.58
12	301131	聚赛龙	2,124,535.72	13.34
13	000890	法尔胜	2,118,393.00	13.30
14	603226	菲林格尔	2,062,032.00	12.94
15	600444	国机通用	1,971,612.00	12.38
16	600149	廊坊发展	1,887,221.09	11.85
17	002304	洋河股份	1,881,321.00	11.81
18	603536	惠发食品	1,872,773.20	11.76
19	002199	东晶电子	1,838,658.00	11.54
20	600128	苏豪弘业	1,835,074.00	11.52
21	002767	先锋电子	1,798,768.00	11.29
22	300665	飞鹿股份	1,774,948.00	11.14
23	600697	欧亚集团	1,748,789.00	10.98
24	002494	华斯股份	1,729,109.00	10.85
25	001209	洪兴股份	1,718,590.00	10.79
26	603696	安记食品	1,713,101.00	10.75
27	600083	博信股份	1,708,041.00	10.72
28	600099	林海股份	1,702,378.00	10.69
29	600889	南京化纤	1,674,289.40	10.51
30	600768	宁波富邦	1,596,874.00	10.02
31	603725	天安新材	1,566,956.88	9.84

32	002691	冀凯股份	1,527,154.00	9.59
33	605178	时空科技	1,508,880.00	9.47
34	603860	中公高科	1,492,013.00	9.37
35	301231	荣信文化	1,488,755.00	9.34
36	003004	声迅股份	1,471,077.00	9.23
37	002058	威尔泰	1,464,176.00	9.19
38	002856	美芝股份	1,456,231.00	9.14
39	300929	华骐环保	1,429,192.00	8.97
40	600689	上海三毛	1,421,415.00	8.92
41	603021	山东华鹏	1,394,963.00	8.76
42	600455	博通股份	1,379,423.00	8.66
43	000632	三木集团	1,360,294.00	8.54
44	600593	大连圣亚	1,351,032.00	8.48
45	300387	富邦股份	1,336,075.00	8.39
46	300262	巴安水务	1,327,847.00	8.33
47	603038	华立股份	1,311,996.12	8.24
48	603838	四通股份	1,297,672.00	8.15
49	600097	开创国际	1,291,072.00	8.10
50	002806	华锋股份	1,274,208.00	8.00
51	600506	统一股份	1,257,291.00	7.89
52	600241	时代万恒	1,225,117.00	7.69
53	300644	南京聚隆	1,141,413.00	7.16
54	002861	瀛通通讯	1,132,557.40	7.11
55	603721	中广天择	1,114,772.00	7.00
56	688004	博汇科技	1,110,228.41	6.97
57	002591	恒大高新	1,108,766.00	6.96
58	688296	和达科技	1,100,519.12	6.91
59	601117	中国化学	1,094,726.00	6.87
60	300405	科隆股份	1,079,736.00	6.78
61	688038	中科通达	1,078,507.21	6.77
62	600232	金鹰股份	1,076,886.00	6.76
63	300462	华铭智能	1,066,999.00	6.70
64	300883	龙利得	1,057,633.00	6.64
65	603608	天创时尚	1,050,796.00	6.60
66	603090	宏盛股份	1,044,781.00	6.56
67	300321	同大股份	1,033,587.00	6.49
68	603320	迪贝电气	1,031,347.00	6.47
69	002893	京能热力	1,029,569.00	6.46
70	301113	雅艺科技	991,985.00	6.23
71	000661	长春高新	990,761.00	6.22
72	605255	天普股份	990,550.00	6.22

73	603580	艾艾精工	984,519.00	6.18
74	002205	国统股份	973,887.00	6.11
75	603392	万泰生物	971,384.20	6.10
76	600712	南宁百货	956,779.00	6.01
77	000858	五粮液	930,688.00	5.84
78	600809	山西汾酒	929,827.00	5.84
79	300254	仟源医药	921,910.00	5.79
80	603329	上海雅仕	890,378.00	5.59
81	000568	泸州老窖	879,825.00	5.52
82	000573	粤宏远 A	873,139.00	5.48
83	002898	赛隆药业	864,563.00	5.43
84	688669	聚石化学	863,961.61	5.42
85	600281	华阳新材	858,872.00	5.39
86	688260	昀冢科技	856,732.86	5.38
87	002778	中晟高科	840,556.00	5.28
88	688335	复洁环保	840,532.38	5.28
89	600276	恒瑞医药	833,098.00	5.23
90	301208	中亦科技	825,156.44	5.18
91	002555	三七互娱	824,401.00	5.17
92	603499	翔港科技	815,106.00	5.12
93	301228	实朴检测	814,188.00	5.11
94	300808	久量股份	811,644.00	5.09
95	688685	迈信林	805,329.21	5.05
96	301067	显盈科技	803,727.00	5.04
97	688178	万德斯	803,562.18	5.04
98	600137	浪莎股份	802,967.00	5.04
99	301233	盛帮股份	797,418.00	5.01
100	300920	润阳科技	796,851.00	5.00
101	603958	哈森股份	791,832.00	4.97
102	603717	天域生态	785,738.00	4.93
103	688681	科汇股份	765,752.85	4.81
104	600519	贵州茅台	762,758.00	4.79
105	600057	厦门象屿	760,641.00	4.77
106	600036	招商银行	755,665.00	4.74
107	601318	中国平安	742,014.00	4.66
108	603616	韩建河山	741,205.00	4.65
109	603385	惠达卫浴	734,840.00	4.61
110	688393	安必平	723,521.42	4.54
111	688215	瑞晟智能	722,073.59	4.53
112	603657	春光科技	721,574.00	4.53
113	300594	朗进科技	715,308.00	4.49

114	300823	建科机械	714,788.00	4.49
115	300911	亿田智能	704,531.00	4.42
116	002836	新宏泽	703,664.20	4.42
117	603259	药明康德	700,500.00	4.40
118	002987	京北方	686,914.00	4.31
119	603316	诚邦股份	682,961.00	4.29
120	603029	天鹅股份	680,976.00	4.27
121	001211	双枪科技	675,703.00	4.24
122	688251	井松智能	671,209.22	4.21
123	000425	徐工机械	667,760.00	4.19
124	000739	普洛药业	654,501.00	4.11
125	603036	如通股份	653,861.00	4.10
126	301081	严牌股份	650,501.00	4.08
127	600692	亚通股份	640,540.00	4.02
128	688016	心脉医疗	639,358.27	4.01
129	300753	爱朋医疗	633,353.00	3.98
130	002357	富临运业	623,801.00	3.92
131	605266	健之佳	622,236.00	3.91
132	600755	厦门国贸	620,986.00	3.90
133	603286	日盈电子	616,386.00	3.87
134	300334	津膜科技	615,593.00	3.86
135	605003	众望布艺	611,436.00	3.84
136	688115	思林杰	600,847.60	3.77
137	600561	江西长运	600,822.00	3.77
138	601166	兴业银行	597,759.00	3.75
139	600193	创兴资源	592,824.00	3.72
140	603707	健友股份	591,557.00	3.71
141	300601	康泰生物	591,301.00	3.71
142	301209	联合化学	590,185.00	3.70
143	301049	超越科技	585,135.00	3.67
144	300243	瑞丰高材	584,779.73	3.67
145	300955	嘉亨家化	584,635.00	3.67
146	300836	佰奥智能	578,488.00	3.63
147	000638	万方发展	577,703.00	3.63
148	002888	惠威科技	576,905.00	3.62
149	003001	中岩大地	572,814.00	3.60
150	600900	长江电力	572,214.00	3.59
151	300992	泰福泵业	570,274.00	3.58
152	002727	一心堂	564,964.88	3.55
153	603615	茶花股份	564,572.00	3.54
154	300630	普利制药	560,716.00	3.52

155	600493	凤竹纺织	556,421.00	3.49
156	688067	爱威科技	552,548.42	3.47
157	002719	麦趣尔	552,137.20	3.47
158	688328	深科达	552,038.93	3.47
159	688096	京源环保	550,105.15	3.45
160	300242	佳云科技	549,646.00	3.45
161	600243	青海华鼎	549,118.00	3.45
162	301040	中环海陆	546,903.00	3.43
163	300816	艾可蓝	546,461.00	3.43
164	002180	纳思达	546,283.00	3.43
165	688501	青达环保	545,302.55	3.42
166	300956	英力股份	545,112.00	3.42
167	600582	天地科技	543,815.00	3.41
168	300819	聚杰微纤	541,797.00	3.40
169	603037	凯众股份	537,419.40	3.37
170	001336	楚环科技	537,212.00	3.37
171	300725	药石科技	535,977.00	3.36
172	603089	正裕工业	532,162.20	3.34
173	300845	捷安高科	528,719.00	3.32
174	300564	筑博设计	524,744.00	3.29
175	603729	龙韵股份	522,908.00	3.28
176	002890	弘宇股份	522,907.00	3.28
177	300554	三超新材	522,835.00	3.28
178	301079	邵阳液压	520,532.00	3.27
179	600926	杭州银行	519,071.00	3.26
180	603272	联翔股份	518,812.00	3.26
181	688395	正弦电气	516,908.12	3.24
182	688229	博睿数据	514,819.75	3.23
183	603813	原尚股份	513,915.00	3.23
184	688129	东来技术	510,710.08	3.21
185	605298	必得科技	509,764.00	3.20
186	300980	祥源新材	508,087.00	3.19
187	301125	腾亚精工	505,349.00	3.17
188	688235	百济神州	501,440.04	3.15
189	688118	普元信息	500,789.44	3.14
190	300886	华业香料	500,434.00	3.14
191	002802	洪汇新材	498,863.80	3.13
192	002049	紫光国微	497,666.00	3.12
193	002050	三花智控	495,022.00	3.11
194	600009	上海机场	494,822.00	3.11
195	300984	金沃股份	487,316.00	3.06

196	605303	园林股份	482,155.00	3.03
197	688367	工大高科	478,706.86	3.00
198	600319	亚星化学	471,176.00	2.96
199	688687	凯因科技	468,157.17	2.94
200	688679	通源环境	463,286.03	2.91
201	600030	中信证券	457,114.00	2.87
202	601888	中国中免	449,992.00	2.82
203	688517	金冠电气	447,037.93	2.81
204	603900	莱绅通灵	439,606.00	2.76
205	002271	东方雨虹	436,455.00	2.74
206	301071	力量钻石	436,016.00	2.74
207	600690	海尔智家	431,938.00	2.71
208	600051	宁波联合	425,508.00	2.67
209	000333	美的集团	413,480.00	2.60
210	688597	煜邦电力	410,448.03	2.58
211	603269	海鸥股份	406,093.00	2.55
212	300749	顶固集创	401,349.00	2.52
213	600882	妙可蓝多	396,417.00	2.49
214	002921	联诚精密	387,033.00	2.43
215	301526	国际复材	385,102.73	2.42
216	000977	浪潮信息	384,560.00	2.41
217	300417	南华仪器	376,032.00	2.36
218	603810	丰山集团	375,728.00	2.36
219	600761	安徽合力	374,803.00	2.35
220	300970	华绿生物	374,038.00	2.35
221	300210	森远股份	372,303.00	2.34
222	601899	紫金矿业	371,108.00	2.33
223	600887	伊利股份	369,534.00	2.32
224	600358	国旅联合	368,697.00	2.31
225	600202	哈空调	368,316.00	2.31
226	603444	吉比特	368,056.00	2.31
227	003023	彩虹集团	366,708.00	2.30
228	300535	达威股份	365,077.00	2.29
229	002696	百洋股份	356,640.00	2.24
230	002830	名雕股份	354,334.00	2.22
231	300391	长药控股	353,626.00	2.22
232	301098	金埔园林	353,480.00	2.22
233	601398	工商银行	352,060.00	2.21
234	688081	兴图新科	347,458.07	2.18
235	300781	因赛集团	347,278.00	2.18
236	300865	大宏立	341,524.00	2.14

237	300270	中威电子	340,073.00	2.13
238	600309	万华化学	339,505.00	2.13
239	603728	鸣志电器	333,809.00	2.10
240	300854	中兰环保	330,219.17	2.07
241	300637	扬帆新材	328,000.00	2.06
242	002963	豪尔赛	326,731.00	2.05
243	603079	圣达生物	326,472.00	2.05
244	301037	保立佳	326,001.00	2.05
245	300971	博亚精工	324,955.00	2.04
246	603221	爱丽家居	318,740.00	2.00

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	726,622,179.73
卖出股票收入（成交）总额	257,796,736.76

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

本基金本报告期末投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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中，云南罗平锌电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云南监管局的行政处罚，广东松发陶瓷股份有限公司在报告编制日前一年内受到上海证券交易所的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	58,749.31
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,804,483.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,863,233.02

### 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

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
16,038	18,720.42	114,668,088.28	38.19%	185,570,065.02	61.81%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	370,392.02	0.1234%

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

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	9,361,568.62
本报告期基金总申购份额	376,270,964.33
减：本报告期基金总赎回份额	85,394,379.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	300,238,153.30

## § 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：

俞任君先生担任公司监事，赵星明先生、梅律吾先生不再担任公司监事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

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

## 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 28,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：4 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

## 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	
光大证券	1	343,908,591.04	34.96%	321,869.53	34.89%	-
华西证券	1	400,785,824.76	40.74%	377,965.35	40.97%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

首创证券	1	239,088,193.00	24.30%	222,622.36	24.13%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

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

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	1,699,567.00	76.89%	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	510,854.09	23.11%	-	-	-	-	-	-

### 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关于旗下部分基金增加国金证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 01 月 05 日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 01 月 05 日

3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2023 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 01 月 05 日
4	诺安多策略混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023 年 01 月 20 日
5	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 01 月 20 日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增聘基金经理的公告	《证券时报》	2023 年 02 月 21 日
7	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 1 期	基金管理人网站	2023 年 02 月 23 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	基金管理人网站	2023 年 02 月 23 日
9	诺安基金管理有限公司关于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	《证券时报》、《中国证券报》	2023 年 02 月 23 日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023 年 03 月 14 日
11	诺安多策略混合型证券投资基金在直销网上交易平台及代销渠道恢复大额申购（含定投）、转换转入业务的公告	《证券时报》	2023 年 03 月 21 日
12	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 03 月 31 日
13	诺安多策略混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
14	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 04 月 22 日
15	诺安多策略混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023 年 04 月 22 日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 05 月 15 日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开展基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 05 月 24 日
18	诺安多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023 年 07 月 05 日

19	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 2 期	基金管理人网站	2023 年 07 月 05 日
20	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	《证券时报》	2023 年 07 月 05 日
21	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 07 月 21 日
22	诺安多策略混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2023 年 07 月 21 日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中欧财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 08 月 04 日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大智慧基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 08 月 07 日
25	诺安多策略混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2023 年 08 月 26 日
26	诺安多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 3 期	基金管理人网站	2023 年 08 月 26 日
27	诺安多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023 年 08 月 26 日
28	诺安多策略混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2023 年 08 月 26 日
29	诺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 08 月 26 日
30	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 08 月 31 日
31	诺安多策略混合型证券投资基金 2023 年中期报告	基金管理人网站	2023 年 08 月 31 日
32	诺安基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 09 月 13 日
33	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 10 月 25 日
34	诺安多策略混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2023 年 10 月 25 日
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、《上海证	2023 年 11 月 24

	金增加贵文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	券报》、《中国证券报》、《证券日报》	日
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》	2023 年 11 月 24 日
37	诺安基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023 年 12 月 28 日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

## § 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

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	1	20230802, 20230809-20230820	-	6,793,326.77	4,251,955.01	2,541,371.76	0.85%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 8 月 26 日披露了《诺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，调低本基金的管理费率及托管费率，并对基金合同等法律文件的有关条款进行修订。

## § 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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2024 年 03 月 29 日