诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§1重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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.....7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
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.....12
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（基金净值）变动表.....16
6.4 报表附注.....17
§7 投资组合报告.....40
7.1 期末基金资产组合情况.....40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....41
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.....42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....53
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.....53
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.....53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....53

7.12 投资组合报告附注.....53
§8 基金份额持有人信息.....55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....55
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.....55
§9 开放式基金份额变动.....55
§10 重大事件揭示.....55
10.1 基金份额持有人大会决议.....55
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.....56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....56
10.4 基金投资策略的改变.....56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....56
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.....56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....56
10.8 其他重大事件.....57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....59
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.....59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....60
§12 备查文件目录.....60
12.1 备查文件目录.....60
12.2 存放地点.....60
12.3 查阅方式.....60

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安和鑫混合
基金主代码	002560
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 10 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,065,388,356.87 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由诺安和鑫保本混合型证券投资基金首个保本周期到期后转型而来，并自 2018 年 5 月 10 日起转型正式生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过积极配置大类资产，动态控制组合风险，并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。 1、大类资产配置 本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。 2、股票投资分析 本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。 3、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。 4、固定收益资产投资策略 本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用

	估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。 5、可转换债券投资策略 本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。 6、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。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，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。 7、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中证全债指数×40%
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，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益的品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	陆志俊
	联系电话	0755-83026688	95559
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-8998	95559
传真		0755-83026677	021-62701216
注册地址		深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		518048	200336
法定代表人		李强	任德奇

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
本期已实现收益	-46,910,419.01
本期利润	693,496,318.36
加权平均基金份额本期利润	0.3078
本期加权平均净值利润率	21.03%
本期基金份额净值增长率	22.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023年06月30日）
期末可供分配利润	-66,377,022.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0321
期末基金资产净值	3,084,872,243.90
期末基金份额净值	1.4936
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023年06月30日）
基金份额累计净值增长率	43.75%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-6.92%	1.81%	0.93%	0.51%	-7.85%	1.30%
过去三个月	-5.11%	2.11%	-2.31%	0.49%	-2.80%	1.62%

过去六个月	22.65%	1.90%	0.83%	0.50%	21.82%	1.40%
过去一年	14.16%	1.89%	-6.94%	0.59%	21.10%	1.30%
过去三年	-0.22%	2.19%	1.42%	0.72%	-1.64%	1.47%
自基金合同生效起至今	43.75%	2.17%	12.75%	0.76%	31.00%	1.41%

注：2018 年 05 月 10 日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中证全债指数×40%。

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：2018 年 05 月 10 日（含当日）起，原“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金。

§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 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡嵩松	本基金基金经理	2019年03月14日	-	8年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、华泰证券股份有限公司，2017年11月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员，现任投资管理部副

					总经理。2021年5月至2023年5月任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年2月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022年7月起任诺安优化配置混合型证券投资基金基金经理，2022年8月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
邓心怡	本基金基金经理	2023年02月18日	-	10年	硕士，具有基金从业资格。曾任职于中国对外贸易信托有限公司，从事投资研究工作，2020年11月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部副总经理，现任研究部总经理。2022年7月起任诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理，2022年10月起任诺安平衡证券投资基金基金经理，2023年2月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023年5月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023年6月起任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

芯片板块上半年表现乏善可陈，主要原因在于两大细分领域芯片设计和芯片设备受制于经济复苏低于预期以及欧洲日韩等美国盟友的联合打压。但是，之前强调的未来行业趋势依然不变。

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1.4936元，本报告期内基金份额净值增长率为22.65%，同期业绩比较基准收益率为0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

芯片设计板块：从2021年四季度开启的芯片产业下行周期，随着疫情落下帷幕，目前基本处于低位区间。产业端一季度库存水平接近正常，各厂商二季度毛利率水平见底。伴随着疫后经济恢复，未来需求端将对设计板块持续拉动。同时我们应该觉察到，随着chatgpt的问世，人工智能出现了突飞猛进的发展，将影响几乎我们所有的行业，或将成为未来最强的产业趋势。海外引领，从算法大模型持续迭代，到各种应用接入AI，再到算力芯片的突飞猛进，产业进展迅速。而算力几何级的增长和边缘侧硬件的拉动，都是未来芯片需求的重要增长。新需求将让芯片周期拐点提前到来。

芯片设备材料EDA：美国对中国半导体的制裁已经到了穷途末路的地步，暨2022年10月7日美国半导体出口新法案对我国晶圆厂极限施压之后，进一步的制裁已经乏善可陈。国内晶圆代工厂一方面加速扩产成熟制程，另一方面在国内设备厂商的配合下，继续研发攻克先进制程。虽然美国的制裁对我国先进制程的扩产造成了一定的影响，但是另外一个角度看，芯片设备的国产化率却取得了突飞猛进的增长。在全球晶圆扩产处于下行周期的大背景下，国产替代进程加速对设备材料EDA板块的拉动，很可能会超预期。

本基金主要布局芯片板块，当前的市场位置芯片板块投资性价比很高，耐心等待。

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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，诺安基金管理有限公司在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由诺安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	584,245,995.99	500,802,712.55
结算备付金		-	691,207.40
存出保证金		771,562.38	729,790.70
交易性金融资产	6.4.7.2	2,500,629,374.45	2,652,972,465.31
其中：股票投资		2,500,629,374.45	2,652,972,465.31
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		5,917,655.68	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,603,296.81	1,481,188.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,095,167,885.31	3,156,677,364.18
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 06 月 30 日**	**上年度末 2022 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		-	-
应付赎回款		4,918,799.91	4,694,094.18
应付管理人报酬		3,923,790.58	4,197,784.57
应付托管费		653,965.09	699,630.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	799,085.83	750,120.53
负债合计		10,295,641.41	10,341,630.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,065,388,356.87	2,583,672,492.98
未分配利润	6.4.7.8	1,019,483,887.03	562,663,241.16
净资产合计		3,084,872,243.90	3,146,335,734.14
负债和净资产总计		3,095,167,885.31	3,156,677,364.18

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.4936元，基金份额总额2,065,388,356.87份。

6.2 利润表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
一、营业总收入		722,334,562.62	-998,113,962.08
1.利息收入		1,983,671.79	922,472.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,983,671.79	922,472.79
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,138,513.23	-271,463,594.91
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-27,670,836.48	-273,571,529.17
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	3,532,323.25	2,107,934.26
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	740,406,737.37	-730,665,602.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,082,666.69	3,092,762.11
减：二、营业总支出		28,838,244.26	29,431,050.71
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	24,613,512.25	25,107,632.56
2．托管费	6.4.10.2.2	4,102,251.99	4,184,605.40
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-

5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.17	122,480.02	138,812.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		693,496,318.36	-1,027,545,012.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		693,496,318.36	-1,027,545,012.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		693,496,318.36	-1,027,545,012.79

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,583,672,492.98	-	562,663,241.16	3,146,335,734.14
二、本期期初净资产（基金净值）	2,583,672,492.98	-	562,663,241.16	3,146,335,734.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-518,284,136.11	-	456,820,645.87	-61,463,490.24
（一）、综合收益总额	-	-	693,496,318.36	693,496,318.36
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-518,284,136.11	-	-236,675,672.49	-754,959,808.60
其中：1.基金申购款	774,336,317.54	-	423,487,955.21	1,197,824,272.75
2.基金赎回款	-1,292,620,453.65	-	-660,163,627.70	-1,952,784,081.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,065,388,356.87	-	1,019,483,887.03	3,084,872,243.90
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综	未分配	净资产合计

		合 收益	利润	
一、上期期末净资产（基金净值）	2,348,357,065.80	-	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31
二、本期期初净资产（基金净值）	2,348,357,065.80	-	1,723,724,260.51	4,072,081,326.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	387,060,171.35	-	-880,322,183.38	-493,262,012.03
（一）、综合收益总额	-	-	-1,027,545,012.79	-1,027,545,012.79
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	387,060,171.35	-	147,222,829.41	534,283,000.76
其中：1.基金申购款	1,042,186,382.33	-	351,835,132.32	1,394,021,514.65
2.基金赎回款	-655,126,210.98	-	-204,612,302.91	-859,738,513.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,735,417,237.15	-	843,402,077.13	3,578,819,314.28

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

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金是根据原诺安和鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“诺安和鑫保本混合基金”)《诺安和鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由原诺安和鑫保本混合基金转型而来。原诺安和鑫保本混合基金为契约型开放式，存续期限不定，原诺安和鑫保本混合基金第一个保本期于2018年5月2日到期，原诺安和鑫保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件，自2018年5月10日起，诺安和鑫保本混合基金更名为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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 0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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×60%+中证全债指数×40%。

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》、《诺安和鑫灵活配置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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净资产（基金净值）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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	584,245,995.99
等于：本金	584,158,201.89
加：应计利息	87,794.10
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	584,245,995.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,455,885,499.07	-	2,500,629,374.45	44,743,875.38
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		2,455,885,499.07	-	2,500,629,374.45	44,743,875.38

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 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,145.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	679,844.35
其中：交易所市场	679,844.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	799,085.83

6.4.7.7 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 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,583,672,492.98	2,583,672,492.98
本期申购	774,336,317.54	774,336,317.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,292,620,453.65	-1,292,620,453.65
本期末	2,065,388,356.87	2,065,388,356.87

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-28,877,135.60	591,540,376.76	562,663,241.16
本期利润	-46,910,419.01	740,406,737.37	693,496,318.36
本期基金份额交易产生的变动数	9,410,531.98	-246,086,204.47	-236,675,672.49
其中：基金申购款	-31,780,340.03	455,268,295.24	423,487,955.21
基金赎回款	41,190,872.01	-701,354,499.71	-660,163,627.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-66,377,022.63	1,085,860,909.66	1,019,483,887.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	1,948,379.96
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	14,938.57
其他	20,353.26
合计	1,983,671.79

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。

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	2,336,963,837.86
减：卖出股票成本总额	2,359,267,577.33
减：交易费用	5,367,097.01
买卖股票差价收入	-27,670,836.48

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 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,532,323.25
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	3,532,323.25

6.4.7.14 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06月30日
1.交易性金融资产	740,406,737.37
--股票投资	740,406,737.37
--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	740,406,737.37

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	3,961,780.35
基金转换费收入	120,886.34
合计	4,082,666.69

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 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	984.08
账户维护费	12,400.00
合计	122,480.02

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,613,512.25	25,107,632.56
其中：支付销售机构的客户维护费	9,833,265.29	8,968,804.24

注：本基金的管理费率为年费率1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,102,251.99	4,184,605.40

注：本基金的托管费率为年费率0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷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

6.4.10.3 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
交通银行股份有限公司-活期存款	584,245,995.99	1,948,379.96	205,141,696.82	879,323.02

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末2023年06月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
30120	国泰	2023年	6个月	新股锁	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

3	环保	03月28日		定						
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

		日								
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股锁定	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	1个月内（含）	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
30142	世纪	2023年	6个月	新股锁	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

8	恒通	05月10日		定						
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股锁定	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年04月24	6个月	新股锁定	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-

		日								
688307	中润光学	2023年02月08日	6个月	新股锁定	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-
688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023年04月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年05月08日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

688522	纳睿雷达	2023年02月22日	6个月	新股锁定	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50	-
688523	航天环宇	2023年05月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年03月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年05月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年06月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
68862	双元	2023年	6个月	新股锁	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

3	科技	05月31日		定						
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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“301281科源制药”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“301322绿通科技”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5股；本基金持有的流通受限股票“688507索辰科技”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股转增0.48股；以上流通受限股票转增股本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。

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交通银行股份有限公司，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 06 月 30 日，本基金无债券投资(2022 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 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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2023 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 2023 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。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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						
银行存款	584,245,995.99	-	-	-	-	584,245,995.99
存出保证金	771,562.38	-	-	-	-	771,562.38
交易性金融资产	-	-	-	-	2,500,629,374.45	2,500,629,374.45
应收清算款	-	-	-	-	5,917,655.68	5,917,655.68
应收申购款	-	-	-	-	3,603,296.81	3,603,296.81
资产总计	585,017,558.37	-	-	-	2,510,150,326.94	3,095,167,885.31
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,918,799.91	4,918,799.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,923,790.58	3,923,790.58
应付托管费	-	-	-	-	653,965.09	653,965.09
其他负债	-	-	-	-	799,085.83	799,085.83

负债总计	-	-	-	-	10,295,641.41	10,295,641.41
利率敏感度缺口	585,017,558.37	-	-	-	2,499,854,685.53	3,084,872,243.90
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						
银行存款	500,802,712.55	-	-	-	-	500,802,712.55
结算备付金	691,207.40	-	-	-	-	691,207.40
存出保证金	729,790.70	-	-	-	-	729,790.70
交易性金融资产	-	-	-	-	2,652,972,465.31	2,652,972,465.31
应收申购款	300.00	-	-	-	1,480,888.22	1,481,188.22
资产总计	502,224,010.65	-	-	-	2,654,453,353.53	3,156,677,364.18
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,694,094.18	4,694,094.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,197,784.57	4,197,784.57
应付托管费	-	-	-	-	699,630.76	699,630.76
其他负债	-	-	-	-	750,120.53	750,120.53
负债总计	-	-	-	-	10,341,630.04	10,341,630.04
利率敏感度缺口	502,224,010.65	-	-	-	2,644,111,723.49	3,146,335,734.14

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 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(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)。

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0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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 2023年06月30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	2,500,629,374.45	81.06	2,652,972,465.31	84.32
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	2,500,629,374.45	81.06	2,652,972,465.31	84.32

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	152,863,754.00	123,175,587.53
	业绩比较基准下降5%	-152,863,754.00	-123,175,587.53

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	2,497,677,603.26	2,614,026,606.67
第二层次	865,434.18	-
第三层次	2,086,337.01	38,945,858.64
合计	2,500,629,374.45	2,652,972,465.31

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2023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(2022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	2,500,629,374.45	80.79
	其中：股票	2,500,629,374.45	80.79
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	584,245,995.99	18.88
8	其他各项资产	10,292,514.87	0.33
9	合计	3,095,167,885.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	123,609.05	0.00
C	制造业	1,712,539,668.79	55.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	548,066.85	0.02
E	建筑业	217,459.00	0.01
F	批发和零售业	53,634,016.81	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	69,312.84	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	731,252,625.32	23.70
J	金融业	115,762.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,266.21	0.00
M	科学研究和技术服务业	605,502.89	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	565,859.04	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,571.97	0.00
Q	卫生和社会工作	890,986.36	0.03
R	文化、体育和娱乐业	30,667.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,500,629,374.45	81.06

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	002371	北方华创	951,833	302,349,752.45	9.80
2	688012	中微公司	1,754,265	274,454,759.25	8.90
3	688521	芯原股份	3,368,512	242,263,383.04	7.85
4	300604	长川科技	3,628,228	172,304,547.72	5.59
5	300661	圣邦股份	1,835,129	150,719,144.77	4.89
6	688153	唯捷创芯	1,959,569	143,362,068.04	4.65
7	688082	盛美上海	1,152,066	127,188,086.40	4.12
8	688256	寒武纪	646,478	121,537,864.00	3.94
9	000977	浪潮信息	2,289,305	111,031,292.50	3.60
10	002230	科大讯飞	1,379,283	93,736,072.68	3.04
11	603019	中科曙光	1,684,800	85,756,320.00	2.78
12	688126	沪硅产业	3,815,183	79,737,324.70	2.58
13	603986	兆易创新	589,209	62,603,456.25	2.03
14	002373	千方科技	4,578,295	62,447,943.80	2.02
15	688502	茂莱光学	309,449	59,414,208.00	1.93
16	300474	景嘉微	593,000	53,364,070.00	1.73
17	300418	昆仑万维	1,317,536	53,070,350.08	1.72
18	300475	香农芯创	2,051,869	52,589,402.47	1.70
19	688152	麒麟信安	504,837	46,586,358.36	1.51
20	603303	得邦照明	3,194,350	44,113,973.50	1.43
21	688435	英方软件	528,035	40,151,781.40	1.30
22	301208	中亦科技	663,537	36,713,502.21	1.19
23	601360	三六零	2,456,000	30,798,240.00	1.00
24	688557	兰剑智能	490,974	17,321,562.72	0.56
25	688343	云天励飞	24,961	1,587,769.21	0.05
26	688249	晶合集成	74,041	1,391,155.62	0.05
27	688472	阿特斯	62,602	1,141,108.20	0.04
28	301358	湖南裕能	20,226	887,880.50	0.03
29	688469	中芯集成	137,994	778,837.98	0.03
30	301260	格力博	31,202	763,699.40	0.02
31	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.02
32	688498	源杰科技	2,215	631,275.00	0.02
33	301267	华厦眼科	10,052	612,669.40	0.02
34	688531	日联科技	3,460	509,505.76	0.02
35	688503	聚和材料	4,850	472,875.00	0.02
36	688114	华大智造	5,336	461,884.16	0.01
37	688392	骄成超声	3,843	426,534.57	0.01

38	688146	中船特气	10,101	422,147.43	0.01
39	301325	曼恩斯特	3,636	413,937.80	0.01
40	688484	南芯科技	10,071	410,399.28	0.01
41	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.01
42	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
43	001287	中电港	13,860	375,661.44	0.01
44	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.01
45	601061	中信金属	40,154	347,732.92	0.01
46	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.01
47	301301	川宁生物	35,740	320,230.40	0.01
48	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.01
49	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.01
50	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
51	688035	德邦科技	4,981	296,269.88	0.01
52	301246	宏源药业	9,303	290,969.49	0.01
53	688275	万润新能	3,206	289,597.98	0.01
54	301391	卡莱特	2,470	289,409.90	0.01
55	688507	索辰科技	2,213	287,192.75	0.01
56	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.01
57	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.01
58	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
59	688401	路维光电	7,173	269,274.42	0.01
60	688161	威高骨科	6,138	265,836.78	0.01
61	688362	甬矽电子	7,779	258,962.91	0.01
62	688410	山外山	4,853	254,782.50	0.01
63	688539	高华科技	5,334	247,497.60	0.01
64	301311	昆船智能	8,320	245,273.60	0.01
65	301303	真兰仪表	10,574	241,150.32	0.01
66	688552	航天南湖	9,556	239,960.00	0.01
67	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.01
68	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.01
69	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.01
70	301307	美利信	6,865	230,766.00	0.01
71	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.01
72	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.01
73	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.01
74	301322	绿通科技	3,906	218,181.18	0.01
75	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.01
76	688486	龙迅股份	1,887	207,664.35	0.01
77	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.01
78	301363	美好医疗	4,447	195,623.53	0.01

79	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.01
80	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.01
81	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.01
82	688489	三未信安	2,953	186,777.25	0.01
83	301377	鼎泰高科	7,695	176,985.00	0.01
84	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.01
85	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.01
86	301230	泓博医药	3,762	168,913.80	0.01
87	301439	泓淋电力	9,486	168,338.18	0.01
88	301127	天源环保	16,843	165,229.83	0.01
89	688084	晶品特装	1,875	162,881.25	0.01
90	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
91	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.01
92	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
93	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.01
94	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
95	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
96	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
97	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
98	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
99	301223	中荣股份	8,148	152,530.56	0.00
100	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.00
101	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.00
102	688697	纽威数控	5,837	150,769.71	0.00
103	301387	光大同创	3,070	150,224.31	0.00
104	301280	珠城科技	4,175	149,298.00	0.00
105	688512	慧智微	7,209	147,986.20	0.00
106	688376	美埃科技	3,713	146,626.37	0.00
107	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
108	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.00
109	301335	天元宠物	5,869	139,916.96	0.00
110	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.00
111	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
112	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.00
113	688184	帕瓦股份	4,358	136,231.08	0.00
114	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.00
115	688201	信安世纪	3,151	134,673.74	0.00
116	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.00
117	688132	邦彦技术	4,844	131,659.92	0.00
118	688419	耐科装备	3,039	129,400.62	0.00
119	688292	浩瀚深度	4,503	129,236.10	0.00

120	301277	新天地	6,576	128,297.76	0.00
121	603135	中重科技	6,273	126,392.92	0.00
122	301345	涛涛车业	2,652	126,242.30	0.00
123	688291	金橙子	3,961	125,405.26	0.00
124	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.00
125	301327	华宝新能	1,570	124,202.70	0.00
126	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.00
127	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
128	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
129	601065	江盐集团	8,748	116,094.39	0.00
130	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
131	688252	天德钰	5,201	105,528.29	0.00
132	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.00
133	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.00
134	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
135	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.00
136	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
137	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
138	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
139	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
140	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.00
141	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
142	301220	亚香股份	2,849	97,179.39	0.00
143	601133	柏诚股份	6,632	97,123.52	0.00
144	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.00
145	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.00
146	301265	华新环保	8,181	95,063.22	0.00
147	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.00
148	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.00
149	688420	美腾科技	2,408	93,261.84	0.00
150	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
151	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.00
152	301281	科源制药	3,368	88,415.20	0.00
153	301326	捷邦科技	2,264	86,099.92	0.00
154	688737	中自科技	2,186	85,232.14	0.00
155	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.00
156	301359	东南电子	3,271	83,345.08	0.00
157	301316	慧博云通	3,584	81,894.40	0.00
158	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.00
159	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.00
160	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.00

161	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.00
162	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.00
163	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
164	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.00
165	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.00
166	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.00
167	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
168	688076	诺泰生物	2,189	77,884.62	0.00
169	688455	科捷智能	5,277	77,202.51	0.00
170	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
171	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
172	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
173	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.00
174	301319	唯特偶	1,149	68,767.65	0.00
175	688448	磁谷科技	1,985	67,946.55	0.00
176	301158	德石股份	3,783	65,483.73	0.00
177	301309	万得凯	2,271	62,543.34	0.00
178	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.00
179	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.00
180	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.00
181	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.00
182	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.00
183	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.00
184	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.00
185	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
186	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
187	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.00
188	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.00
189	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
190	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.00
191	001322	箭牌家居	1,595	26,700.30	0.00
192	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
193	603171	税友股份	637	25,467.26	0.00
194	603255	鼎际得	489	24,821.64	0.00
195	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
196	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
197	605060	联德股份	883	24,247.18	0.00
198	605167	利柏特	2,471	23,919.28	0.00
199	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
200	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.00
201	003020	立方制药	632	23,390.32	0.00

202	003029	吉大正元	716	23,234.20	0.00
203	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
204	301171	易点天下	985	21,768.50	0.00
205	605016	百龙创园	872	21,590.72	0.00
206	605133	嵘泰股份	618	21,481.68	0.00
207	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
208	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.00
209	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
210	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.00
211	300902	国安达	551	20,634.95	0.00
212	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.00
213	300869	康泰医学	862	19,791.52	0.00
214	001215	千味央厨	295	19,614.55	0.00
215	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
216	301152	天力锂能	433	19,337.78	0.00
217	300982	苏文电能	317	19,197.52	0.00
218	605377	华旺科技	1,050	18,952.50	0.00
219	605011	杭州热电	525	18,574.50	0.00
220	003012	东鹏控股	2,278	18,429.02	0.00
221	605289	罗曼股份	474	18,158.94	0.00
222	003026	中晶科技	460	18,091.80	0.00
223	003028	振邦智能	432	18,061.92	0.00
224	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
225	605305	中际联合	508	17,708.88	0.00
226	003005	竞业达	577	17,708.13	0.00
227	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.00
228	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
229	003039	顺控发展	1,024	17,367.04	0.00
230	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
231	605339	南侨食品	864	17,202.24	0.00
232	003016	欣贺股份	1,681	16,978.10	0.00
233	605268	王力安防	1,642	16,797.66	0.00
234	001208	华菱线缆	1,754	16,627.92	0.00
235	300878	维康药业	722	16,389.40	0.00
236	301328	维峰电子	287	16,341.78	0.00
237	601686	友发集团	2,374	16,238.16	0.00
238	300882	万胜智能	572	16,233.36	0.00
239	605368	蓝天燃气	1,685	16,125.45	0.00
240	605098	行动教育	405	16,033.95	0.00
241	300893	松原股份	621	15,978.33	0.00
242	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.00

243	605080	浙江自然	524	15,709.52	0.00
244	605068	明新旭腾	641	15,678.86	0.00
245	003037	三和管桩	1,274	15,670.20	0.00
246	605336	帅丰电器	911	15,669.20	0.00
247	605277	新亚电子	966	15,610.56	0.00
248	003019	宸展光电	760	15,580.00	0.00
249	001216	华瓷股份	1,177	15,489.32	0.00
250	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.00
251	300909	汇创达	579	15,297.18	0.00
252	603132	金徽股份	1,342	15,218.28	0.00
253	603759	海天股份	1,656	15,168.96	0.00
254	605162	新中港	1,377	14,802.75	0.00
255	603230	内蒙新华	1,141	14,718.90	0.00
256	301121	紫建电子	290	14,685.60	0.00
257	003025	思进智能	898	14,502.70	0.00
258	603070	万控智造	775	14,484.75	0.00
259	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
260	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.00
261	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
262	605389	长龄液压	498	14,377.26	0.00
263	605208	永茂泰	1,405	14,078.10	0.00
264	601528	瑞丰银行	2,899	14,060.15	0.00
265	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
266	605099	共创草坪	624	13,933.92	0.00
267	003006	百亚股份	804	13,893.12	0.00
268	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.00
269	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.00
270	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
271	301349	信德新材	270	13,537.80	0.00
272	605183	确成股份	741	13,412.10	0.00
273	605169	洪通燃气	1,293	13,279.11	0.00
274	605028	世茂能源	615	13,222.50	0.00
275	605056	咸亨国际	933	13,220.61	0.00
276	003013	地铁设计	724	13,213.00	0.00
277	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
278	605151	西上海	722	13,140.40	0.00
279	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
280	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
281	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
282	605599	菜百股份	980	12,945.80	0.00
283	300908	仲景食品	285	12,924.75	0.00

284	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.00
285	605300	佳禾食品	576	12,522.24	0.00
286	605580	恒盛能源	916	12,356.84	0.00
287	603176	汇通集团	1,924	12,313.60	0.00
288	605058	澳弘电子	548	12,302.60	0.00
289	605319	无锡振华	764	12,124.68	0.00
290	003010	若羽臣	562	11,948.12	0.00
291	605500	森林包装	1,579	11,779.34	0.00
292	300864	南大环境	535	11,759.30	0.00
293	300890	翔丰华	286	11,754.60	0.00
294	605228	神通科技	1,217	11,646.69	0.00
295	003030	祖名股份	480	11,587.20	0.00
296	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
297	603170	宝立食品	542	11,522.92	0.00
298	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
299	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.00
300	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
301	003042	中农联合	546	11,313.12	0.00
302	603836	海程邦达	733	11,266.21	0.00
303	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
304	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
305	601279	英利汽车	2,004	11,102.16	0.00
306	001218	丽臣实业	490	11,078.90	0.00
307	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
308	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
309	605378	野马电池	473	11,025.63	0.00
310	003027	同兴环保	523	10,904.55	0.00
311	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
312	605177	东亚药业	439	10,816.96	0.00
313	300868	杰美特	593	10,792.60	0.00
314	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
315	003015	日久光电	1,128	10,682.16	0.00
316	003033	征和工业	301	10,565.10	0.00
317	300881	盛德鑫泰	320	10,544.00	0.00
318	603219	富佳股份	739	10,530.75	0.00
319	603216	梦天家居	772	10,522.36	0.00
320	003036	泰坦股份	776	10,460.48	0.00
321	300891	惠云钛业	1,143	10,447.02	0.00
322	605122	四方新材	703	10,432.52	0.00
323	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
324	301318	维海德	309	10,366.95	0.00

325	603215	比依股份	575	10,315.50	0.00
326	605179	一鸣食品	939	10,216.32	0.00
327	300907	康平科技	473	10,155.31	0.00
328	001288	运机集团	537	10,149.30	0.00
329	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
330	300877	金春股份	569	10,037.16	0.00
331	605005	合兴股份	634	10,036.22	0.00
332	605566	福莱蕙特	435	10,005.00	0.00
333	001366	播恩集团	646	9,961.32	0.00
334	003018	金富科技	1,027	9,931.09	0.00
335	001212	中旗新材	400	9,876.00	0.00
336	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
337	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
338	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
339	605365	立达信	645	9,662.10	0.00
340	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
341	603511	爱慕股份	553	9,511.60	0.00
342	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
343	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.00
344	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
345	605299	舒华体育	738	9,372.60	0.00
346	001206	依依股份	629	9,309.20	0.00
347	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
348	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.00
349	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
350	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.00
351	301197	工大科雅	380	9,158.00	0.00
352	300876	蒙泰高新	350	9,117.50	0.00
353	605007	五洲特纸	598	9,065.68	0.00
354	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
355	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
356	300879	大叶股份	466	8,867.98	0.00
357	003004	声迅股份	306	8,834.22	0.00
358	605258	协和电子	340	8,833.20	0.00
359	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
360	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00
361	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
362	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
363	003032	传智教育	586	8,538.02	0.00
364	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
365	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00

366	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
367	001210	金房能源	373	8,377.58	0.00
368	605196	华通线缆	1,172	8,344.64	0.00
369	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
370	605189	富春染织	508	8,336.28	0.00
371	605287	德才股份	349	8,271.30	0.00
372	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
373	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
374	605298	必得科技	508	8,107.68	0.00
375	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
376	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
377	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.00
378	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
379	003041	真爱美家	503	7,977.58	0.00
380	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
381	003023	彩虹集团	385	7,896.35	0.00
382	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
383	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
384	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
385	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
386	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
387	300889	爱克股份	479	7,170.63	0.00
388	605155	西大门	490	7,109.90	0.00
389	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
390	605055	迎丰股份	1,146	6,830.16	0.00
391	300991	创益通	406	6,824.86	0.00
392	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
393	605303	园林股份	610	6,771.00	0.00
394	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
395	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
396	603150	万朗磁塑	251	6,616.36	0.00
397	300892	品渥食品	272	6,228.80	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	300474	景嘉微	197,982,691.63	6.29
2	300339	润和软件	139,996,486.10	4.45
3	688711	宏微科技	72,821,941.88	2.31

4	688256	寒武纪	69,999,974.68	2.22
5	000977	浪潮信息	69,999,076.45	2.22
6	300418	昆仑万维	69,998,964.13	2.22
7	002230	科大讯飞	69,996,024.69	2.22
8	603019	中科曙光	66,997,517.56	2.13
9	688502	茂莱光学	65,101,190.61	2.07
10	688041	海光信息	64,999,994.28	2.07
11	603986	兆易创新	64,989,611.10	2.07
12	002373	千方科技	64,492,281.75	2.05
13	603303	得邦照明	63,763,246.68	2.03
14	688435	英方软件	60,599,427.70	1.93
15	601360	三六零	59,999,740.00	1.91
16	300475	香农芯创	59,766,623.44	1.90
17	688515	裕太微	58,407,716.64	1.86
18	603701	德宏股份	39,076,059.12	1.24
19	688557	兰剑智能	29,999,893.09	0.95
20	688152	麒麟信安	16,902,922.56	0.54

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600536	中国软件	378,030,776.37	12.01
2	002180	纳思达	235,360,831.55	7.48
3	688126	沪硅产业	197,317,084.54	6.27
4	002268	电科网安	181,410,188.96	5.77
5	688521	芯原股份	159,169,098.49	5.06
6	300339	润和软件	151,506,462.25	4.82
7	300474	景嘉微	122,613,665.43	3.90
8	603501	韦尔股份	99,366,738.15	3.16
9	688041	海光信息	81,530,201.55	2.59
10	300418	昆仑万维	75,803,426.91	2.41
11	600703	三安光电	63,220,683.91	2.01
12	688409	富创精密	60,593,767.43	1.93
13	688372	伟测科技	60,360,355.74	1.92
14	688711	宏微科技	56,063,969.22	1.78
15	688515	裕太微	54,559,365.16	1.73
16	601360	三六零	49,620,306.92	1.58
17	301095	广立微	49,488,042.07	1.57
18	301208	中亦科技	36,752,298.90	1.17
19	688256	寒武纪	34,395,354.79	1.09

20	688120	华海清科	33,498,765.82	1.06

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,466,517,749.10
卖出股票收入（成交）总额	2,336,963,837.86

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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，除芯原股份外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

芯原微电子(上海)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上海监管局的行政监管措施。

截至本报告期末，芯原股份（688521）为本基金前十大重仓股。芯原股份是国内市占率第一，全球市占率第七的芯片IP提供商。随着中美科技对抗态势逐渐加剧，IP与EDA等芯片设计环节中最重要的“卡脖子”环节，在中美科技竞争中占有战略制高地。且随着芯片制程的不断进步，芯片设计环节越来越复杂，设计公司将越来越依靠上游的IP服务商，IP整个行业的近几年增速维持高位，全球芯片IP市场290亿元，芯原股份市占率2%。除了IP业务以外，芯原股份的定制芯片量产业务也发展迅速，近些年，互联网公司、汽车公司造芯运动的发展如火如荼，这些系统厂商对定制化芯片设计的需求越来越高，芯原股份的量产芯片设计业务结合他们的强势IP，发展迅速，其客户下游覆盖数据中心、汽车、消费电子，这块业务的爆发将为公司长期提供利润增长。

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	771,562.38
2	应收清算款	5,917,655.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,603,296.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,292,514.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
187,102	11,038.84	176,645,797.21	8.55%	1,888,742,559.66	91.45%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,558,030.61	0.0754%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 05 月 10 日）基金份额总额	270,829,069.66
本报告期期初基金份额总额	2,583,672,492.98
本报告期基金总申购份额	774,336,317.54
减：本报告期基金总赎回份额	1,292,620,453.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,065,388,356.87

§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：

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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	225,561,282.88	5.96%	162,698.34	5.96%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	310,014,690.23	8.19%	223,615.64	8.19%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	1,877,828,311.35	49.63%	1,354,455.42	49.63%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	1,370,107,558.48	36.21%	988,260.21	36.21%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

（1）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要，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》。

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
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“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
3	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
4	诺安和鑫灵活配置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	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	《证券时报》	2023年02月18日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福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》	2023年02月20日
7	诺安和鑫灵活配置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22日
8	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》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年02月22日
9	诺安和鑫灵活配置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22日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通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03月15日
11	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03月20日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加银泰证券为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03月20日
13	诺安和鑫灵活配置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03月23日
14	诺安和鑫灵活配置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03月23日
15	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）	《证券时报》	2023年03月23日

	的提示性公告		
16	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
17	诺安和鑫灵活配置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
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加湘财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04月12日
19	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加山西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》	2023年04月14日
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新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04月20日
21	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
22	诺安和鑫灵活配置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
23	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
24	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
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年05月26日

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

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

11.2 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。

§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和鑫保本混合型证券投资基金公开募集的文件。

②原诺安和鑫保本混合型证券投资基金转型为诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的相关公告。

③《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

④《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

⑤《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。

⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑦报告期内诺安和鑫灵活配置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
2023 年 08 月 31 日