

诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）  
2026 年第 2 季度报告

2026 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：招商银行股份有限公司  
报告送出日期：2026 年 07 月 21 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                                                                             |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）                                                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 026797                                                                                                                                                                      |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2026 年 02 月 04 日                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 21,296,196.59 份                                                                                                                                                             |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产配置和基金优选策略，力争获得长期稳健的投资回报。                                                                                                                               |
| 投资策略       | 本基金将综合运用资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、公募 REITs 投资策略。                                                                                                               |
| 业绩比较基准     | 中证 800 指数收益率*50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债综合（全价）指数收益率*45%                                                                                                                     |
| 风险收益特征     | <p>本基金属于混合型基金中基金（FOF），本基金理论上预期风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票和港股通 ETF，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异</p> |

|                 |                       |                       |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 带来的特有风险。              |                       |
| 基金管理人           | 诺安基金管理有限公司            |                       |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司            |                       |
| 下属分级基金的基金简称     | 诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）A | 诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 026797                | 026798                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 21,296,187.34 份       | 9.25 份                |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |                       |
|-----------------|----------------------------------------|-----------------------|
|                 | 诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）A                  | 诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C |
| 1. 本期已实现收益      | 542,152.01                             | 0.13                  |
| 2. 本期利润         | 1,949,055.69                           | 0.21                  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0964                                 | 0.0234                |
| 4. 期末基金资产净值     | 23,437,467.24                          | 10.21                 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1005                                 | 1.1038                |

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

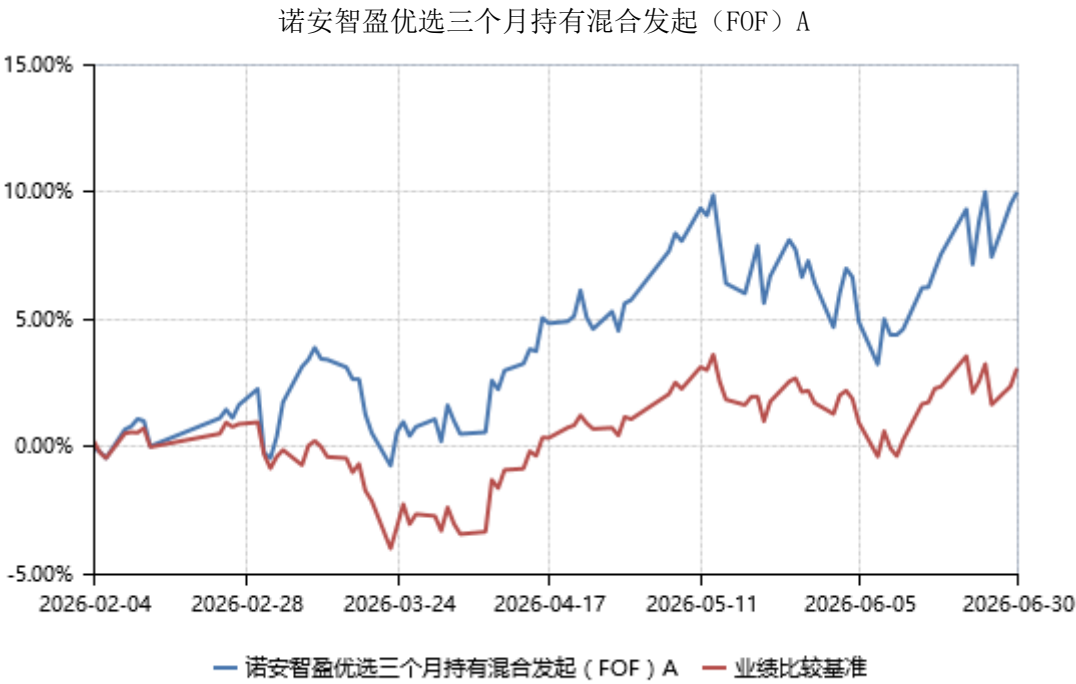
诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 9.75%      | 1.09%         | 6.58%          | 0.71%                 | 3.17% | 0.38% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 10.05%     | 1.00%         | 3.14%          | 0.69%                 | 6.91% | 0.31% |

诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 2.08%      | 1.25%         | 0.79%          | 0.76%                 | 1.29% | 0.49% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C



注：1、本基金合同生效日为 2026 年 02 月 04 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金的建仓期为 6 个月，截至 2026 年 06 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

3、本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                               |
|----|---------|------------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                  |
| 杨帆 | 本基金基金经理 | 2026 年 02 月 04 日 | -    | 21 年   | 硕士，具有基金从业资格。曾就职于莫尼塔（上海）投资发展有限公司任研究员，敦和资产管理有限公司任高级研究员，在长信基金管理有限责任公司先后担任研究员、国际业务部总监兼基金经理、养老 FOF 投资部总监兼基金经理。2023 年 5 月加入诺安基金管理有限公司， |

|  |  |  |  |  |                                                       |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 历任投资经理等。2026 年 2 月起任诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------|

注：①对于首任基金经理，上述“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对于非首任基金经理，上述“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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 公平交易专项说明

### 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，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

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

组合。对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并下达申购指令；公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金运用多元资产配置的投资方式，将组合资产分散配置在权益、商品、固收等大类资产中，以绝对收益为首要目标，致力于提高组合的收益风险比，为持有人提供良好的持有体验。进入 2026 年，我们对宏观形势有两个基本判断，一是宏观经济从持续多年的严重通缩逐渐过渡到再通胀；二是 AI 投资浪潮仍在持续。相应的，我们对大类资产配置的思路，一是提高权益资产中成长策略的投资比例，二是始终保持投资组合中商品的配置比例。

回顾二季度的市场表现，全球以 AI 为主线的科技资产大幅上涨，美股费城半导体指数上涨 87.75%，韩国 SK 海力士上涨 228.43%。A 股市场创业板指数上涨 36.35%，科创 50 指数上涨 75.74%。上涨板块高度集中在以光模块、PCB 上游、半导体设备为主的科技细分赛道中，其他传统价值板块则几乎全线下跌，中证红利指数下跌 12.32%，各个行业表现极端分化，市场风格极致。同时，受到美联储加息预期升温的影响，商品价格在二季度表现不佳，上海金二季度下跌 13%左右。二季度，组合提高了权益资产中科技成长的比例，带来了正面贡献。同时，由于价值型板块和商品价格的下跌，组合对价值类权益资产和商品类资产的配置则带来了一定的拖累。二季度本基金 A 类基金份额净值增长了 9.75%。

展望三季度，AI 投资浪潮仍在持续，然而随着相关指数和板块在过去几个月间累积了较大涨幅，市场整体波动可能将加大，科技内部细分赛道分化会加大。本产品以绝对收益为首要目标，持仓中的价值板块和商品二季度虽然拖累了组合净值，但也会对科技成长形成一定对冲。我们会持续跟踪各类资产表现，做

好资产之间、资产内部，以及各类风险的再平衡。努力控制回撤，提高组合的收益风险比，为持有人创造长期良好的持有体验。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）A 份额净值为 1.1005 元，本报告期诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）A 份额净值增长率为 9.75%，同期业绩比较基准收益率为 6.58%；截至本报告期末诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C 份额净值为 1.1038 元，本报告期诺安智盈优选三个月持有混合发起（FOF）C 份额净值增长率为 2.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满三年，故不存在需要说明的情况。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 238,309.69    | 0.85         |
|    | 其中：股票             | 238,309.69    | 0.85         |
| 2  | 基金投资              | 19,678,044.76 | 70.31        |
| 3  | 固定收益投资            | 1,211,788.71  | 4.33         |
|    | 其中：债券             | 1,211,788.71  | 4.33         |
|    | 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          | 1,200,000.00  | 4.29         |
|    | 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      | 1,097,002.86  | 3.92         |
| 8  | 其他资产              | 4,562,529.51  | 16.30        |
| 9  | 合计                | 27,987,675.53 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 79,489.69 元，占资产净值比例为 0.34%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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              |            |      |
| C | 制造业              | 158,820.00 | 0.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 |            |      |
| E | 建筑业              |            |      |
| F | 批发和零售业           |            |      |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      |            |      |
| H | 住宿和餐饮业           |            |      |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  |            |      |
| J | 金融业              |            |      |
| K | 房地产业             |            |      |
| L | 租赁和商务服务业         |            |      |
| M | 科学研究和技术服务业       |            |      |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    |            |      |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    |            |      |
| P | 教育               |            |      |
| Q | 卫生和社会工作          |            |      |
| R | 文化、体育和娱乐业        |            |      |
| S | 综合               |            |      |
|   | 合计               | 158,820.00 | 0.68 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
| 能源   | 79,489.69 | 0.34         |
| 合计   | 79,489.69 | 0.34         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 688981 | 中芯国际   | 1,000 | 158,820.00 | 0.68         |
| 2  | 00857  | 中国石油股份 | 6,000 | 44,191.82  | 0.19         |
| 3  | 00883  | 中国海洋石油 | 2,000 | 35,297.87  | 0.15         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
| 1  | 国家债券      | 1,211,788.71 | 5.17 |
| 2  | 央行票据      | —            | —    |
| 3  | 金融债券      | —            | —    |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —    |
| 4  | 企业债券      | —            | —    |
| 5  | 企业短期融资券   | —            | —    |
| 6  | 中期票据      | —            | —    |
| 7  | 可转债（可交换债） | —            | —    |
| 8  | 同业存单      | —            | —    |
| 9  | 其他        | —            | —    |
| 10 | 合计        | 1,211,788.71 | 5.17 |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019792 | 25 国债 19 | 10,000 | 1,010,492.33 | 4.31         |
| 2  | 019827 | 26 国债 01 | 2,000  | 201,296.38   | 0.86         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 18,614.13    |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,543,915.38 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 4,562,529.51 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

## § 6 基金中基金

#### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称      | 运作方式 | 持有份额(份)      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-----------|------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 159985 | 豆粕 ETF 华夏 | 交易型开 | 1,530,000.00 | 3,037,050.00 | 12.96        | 否                      |

|    |        |                   |            |            |              |      |   |
|----|--------|-------------------|------------|------------|--------------|------|---|
|    |        |                   | 放式         |            |              |      |   |
| 2  | 511880 | 银华日利 ETF          | 交易型开<br>放式 | 20,000.00  | 2,011,180.00 | 8.58 | 否 |
| 3  | 511260 | 十年国债 ETF 国<br>泰   | 交易型开<br>放式 | 11,600.00  | 1,564,306.40 | 6.67 | 否 |
| 4  | 511520 | 政金债 ETF 富国        | 交易型开<br>放式 | 12,900.00  | 1,521,671.10 | 6.49 | 否 |
| 5  | 511360 | 短融 ETF 海富通        | 交易型开<br>放式 | 10,000.00  | 1,136,100.00 | 4.85 | 否 |
| 6  | 009224 | 宝盈现代服务业<br>混合 C   | 契约型开<br>放式 | 553,259.71 | 688,199.75   | 2.94 | 否 |
| 7  | 021642 | 富国资源精选混<br>合发起式 A | 契约型开<br>放式 | 345,795.11 | 684,674.32   | 2.92 | 否 |
| 8  | 008619 | 永赢医药健康 C          | 契约型开<br>放式 | 574,439.25 | 669,566.39   | 2.86 | 否 |
| 9  | 010159 | 中银医疗保健混<br>合 C    | 契约型开<br>放式 | 240,842.29 | 648,540.12   | 2.77 | 否 |
| 10 | 159981 | 能源化工 ETF 建<br>信   | 交易型开<br>放式 | 436,900.00 | 619,524.20   | 2.64 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2026 年 04 月 01 日至 2026<br>年 06 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管<br>理人以及管理人关联方<br>所管理基金产生的费用 |
|----------------------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | 3,426.88                                      | -                                       |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | 3,559.83                                      | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 4,527.89                                      | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 26,465.06                                     | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 5,054.19                                      | -                                       |
| 当期交易所交易基金产生的交易费（元）   | 6,434.36                                      | -                                       |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 诺安智盈优选三个月<br>持有混合发起（FOF）A | 诺安智盈优选三个<br>月持有混合发起<br>（FOF）C |
|----|---------------------------|-------------------------------|
|    |                           |                               |

|                           |               |      |
|---------------------------|---------------|------|
| 报告期期初基金份额总额               | 19,443,647.58 | —    |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,639,824.78  | 9.25 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 787,285.02    | —    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —             | —    |
| 报告期期末基金份额总额               | 21,296,187.34 | 9.25 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 诺安智盈优选三个月<br>持有混合发起（FOF）A | 诺安智盈优选三个月<br>持有混合发起（FOF）C |
|--------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00             | —                         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | —                         | —                         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | —                         | —                         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00             | —                         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 46.96                     | —                         |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期            | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率 |
|----|------|-----------------|---------------|---------------|------|
| 1  | 认购   | 2026年02月<br>04日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | —    |
| 合计 |      |                 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |      |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照本基金合同及招募说明书的规定执行，具体费率折扣以销售商为准。

§ 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占基金<br>总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金<br>总份额比例 | 发起份额承诺持<br>有期限          |
|-----------------|---------------|------------------|---------------|------------------|-------------------------|
| 基金管理人<br>固有资金   | 10,000,000.00 | 46.96%           | 10,000,000.00 | 46.96%           | 自基金合同生效<br>之日起不少于3<br>年 |
| 基金管理人<br>高级管理人员 | —             | —                | —             | —                | —                       |
| 基金经理等<br>人员     | —             | —                | —             | —                | —                       |

|             |               |        |                   |        |   |
|-------------|---------------|--------|-------------------|--------|---|
| 基金管理人<br>股东 | -             | -      | -                 | -      | - |
| 其他          | -             | -      | -                 | -      | - |
| 合计          | 10,000,000.00 | 46.96% | 10,000,000.0<br>0 | 46.96% | - |

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                   |                  |      | 报告期末持有基金情况        |            |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|-------------------|------------------|------|-------------------|------------|
|                                                                                         | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额              | 申购份额             | 赎回份额 | 持有份额              | 份额占比       |
| 机构                                                                                      | 1              | 20260401-20260630       | 10,000,000.0<br>0 | -                | -    | 10,000,000.0<br>0 | 46.96<br>% |
| 个人                                                                                      | 1              | 20260512-20260630       | 3,624,834.34      | 2,197,782.4<br>2 | -    | 5,822,616.76      | 27.34<br>% |
| 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。 |                |                         |                   |                  |      |                   |            |

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集的文件。

②《诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》。

③《诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》。

④《诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥报告期内诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）在规定媒介上披露的各项公告。

## 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 11.3 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  
2026 年 07 月 21 日