

# 诺安优化收益债券型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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 .....                      | 5  |
| 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 .....              | 12 |
| 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 .....          | 13 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....          | 13 |
| 4.6 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....              | 14 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....             | 14 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....              | 15 |
| 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 .....    | 15 |
| § 5 | 托管人报告 .....                            | 15 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....               | 15 |
| 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 .. | 15 |
| 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 .....   | 15 |
| § 6 | 审计报告 .....                             | 16 |
| 6.1 | 审计报告基本信息 .....                         | 16 |
| 6.2 | 审计报告的基本内容 .....                        | 16 |
| § 7 | 年度财务报表 .....                           | 17 |
| 7.1 | 资产负债表 .....                            | 17 |
| 7.2 | 利润表 .....                              | 19 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 .....                   | 20 |
| 7.4 | 报表附注 .....                             | 21 |
| § 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 .....                 | 45 |
| 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 .....    | 45 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                  | 46 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                 | 47 |

|      |                                         |    |
|------|-----------------------------------------|----|
| 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 .....    | 47 |
| 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 ..... | 47 |
| 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 ..... | 47 |
| 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 .....    | 47 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 48 |
| 8.11 | 投资组合报告附注 .....                          | 48 |
| § 9  | 基金份额持有人信息 .....                         | 51 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51 |
| 9.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51 |
| 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 .....      | 51 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 .....                         | 51 |
| § 11 | 重大事件揭示 .....                            | 51 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 52 |
| 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 .....       | 52 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 52 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 .....                         | 52 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 52 |
| 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 .....          | 52 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 52 |
| 11.8 | 其他重大事件 .....                            | 53 |
| § 12 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 57 |
| 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 .....     | 57 |
| 12.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 57 |
| § 13 | 备查文件目录 .....                            | 58 |
| 13.1 | 备查文件目录 .....                            | 58 |
| 13.2 | 存放地点 .....                              | 58 |
| 13.3 | 查阅方式 .....                              | 58 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 诺安优化收益债券型证券投资基金    |
| 基金简称       | 诺安优化收益债券           |
| 基金主代码      | 320004             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2007 年 08 月 29 日   |
| 基金管理人      | 诺安基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 华夏银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 1,156,749,419.54 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

注：原“诺安中短期债券投资基金”的基金合同生效日为 2006 年 7 月 17 日，2007 年 8 月 29 日《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》生效，“诺安中短期债券投资基金”转型为“诺安优化收益债券型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 确保本金的稳妥和价值的稳定, 力争为投资者提供高于投资基准的回报。                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金的投资策略分为固定收益类品种投资策略和新股投资策略两部分：<br>(1) 固定收益类品种投资策略包括总体资产配置、类属资产配置、期限结构配置、具体个券选择策略和资产支持证券投资策略。<br>(2) 新股申购策略：在我国证券市场中, 由于一、二级市场价差的存在, 参与新股申购常常能够取得较低风险的稳定收益。本基金将在充分研究新发股票基本面的前提下, 参与新股申购, 并且将所得新股在其可交易之日起得 60 个交易日内全部卖出。 |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金, 其长期平均风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金, 高于货币市场基金。                                                                                                                                                                          |

### 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                   | 华夏银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李学君                          | 郑鹏                   |
|         | 联系电话 | 0755-83026688                | 010-85238667         |
|         | 电子邮箱 | info@lionfund.com.cn         | zhengpeng@hxb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-888-8998                 | 95577                |
| 传真      |      | 0755-83026677                | 010-85238680         |
| 注册地址    |      | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号    |

|       |                              |                   |
|-------|------------------------------|-------------------|
| 办公地址  | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号 |
| 邮政编码  | 518048                       | 100005            |
| 法定代表人 | 李强                           | 李民吉               |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                        |
|---------------------|----------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                                   |
| 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 | 2021 年           | 2020 年           | 2019 年         |
|---------------|------------------|------------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 181,820,370.69   | 154,582,912.52   | 11,643,484.76  |
| 本期利润          | 221,903,644.78   | 159,888,966.21   | 35,229,269.25  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2804           | 0.2306           | 0.1482         |
| 本期加权平均净值利润率   | 17.18%           | 16.67%           | 12.94%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 19.84%           | 24.12%           | 20.79%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末          | 2020 年末          | 2019 年末        |
| 期末可供分配利润      | 602,747,574.99   | 235,068,431.19   | 27,989,883.06  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5211           | 0.2853           | 0.0695         |
| 期末基金资产净值      | 2,100,117,162.07 | 1,248,189,726.74 | 491,824,124.00 |
| 期末基金份额净值      | 1.8155           | 1.5149           | 1.2205         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末          | 2020 年末          | 2019 年末        |
| 基金份额累计净值增长率   | 232.71%          | 177.63%          | 123.67%        |

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。

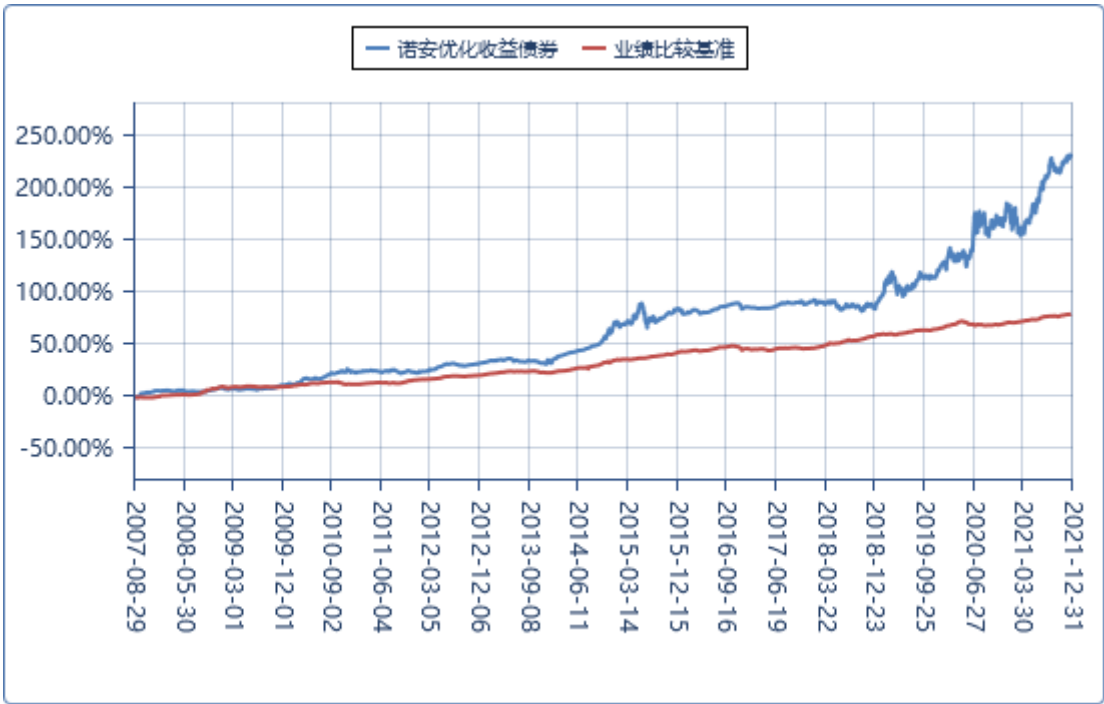
3.2 基金净值表现

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 4.35%        | 0.41%               | 1.25%              | 0.04%                 | 3.10%   | 0.37% |
| 过去六个月          | 14.99%       | 0.55%               | 2.97%              | 0.05%                 | 12.02%  | 0.50% |
| 过去一年           | 19.84%       | 0.81%               | 5.23%              | 0.05%                 | 14.61%  | 0.76% |
| 过去三年           | 79.68%       | 0.86%               | 13.41%             | 0.06%                 | 66.27%  | 0.80% |
| 过去五年           | 79.51%       | 0.69%               | 22.96%             | 0.06%                 | 56.55%  | 0.63% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 232.71%      | 0.47%               | 79.69%             | 0.08%                 | 153.02% | 0.39% |

注：2007 年 08 月 29 日（含当日）起，原“诺安中短期债券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数。

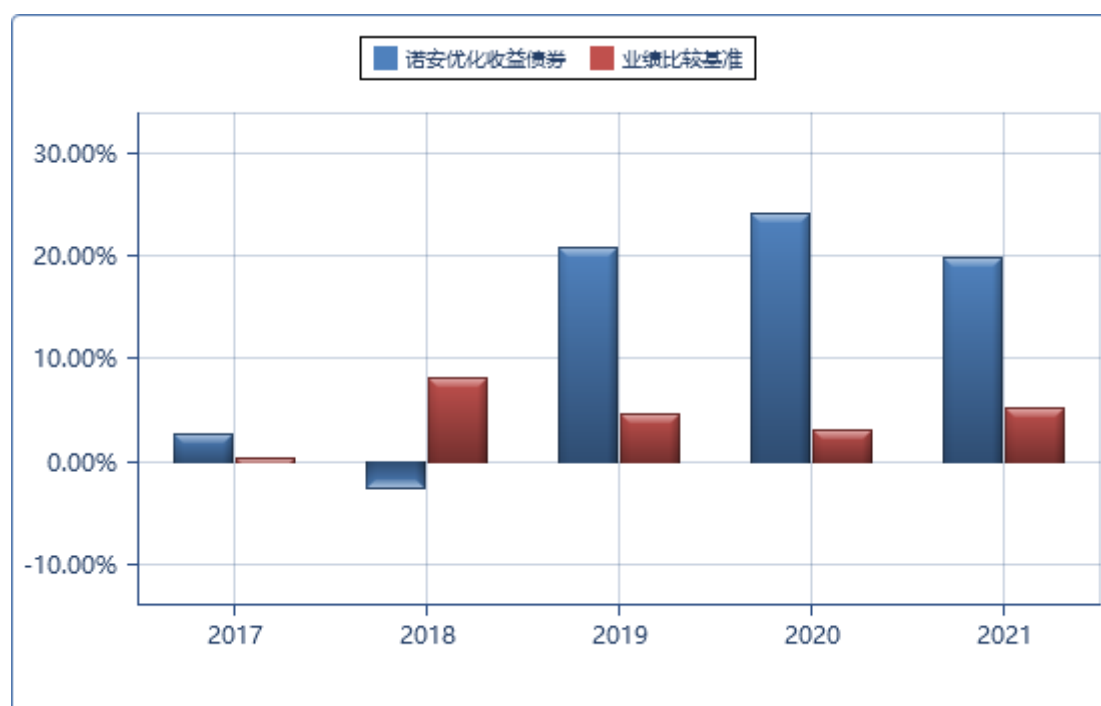
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

2、2007 年 08 月 29 日（含当日）起，原“诺安中短期债券投资基金”转型为本基金，自 2015 年 10 月 14 日起本基金业绩比较基准由原“中信标普全债指数”变更为“中证综合债指数”。

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 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 62 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、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、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、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、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、诺安进取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、诺安恒惠债券型证券投资基金、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<br>（助理）期限 |                     | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                          |
|-----|---------|---------------------|---------------------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         | 任职日期                | 离任日期                |            |                                                                                                                                                                             |
| 张立  | 本基金基金经理 | 2021 年 11 月<br>13 日 | —                   | 8 年        | 硕士，具有基金从业资格，曾任国泰君安证券股份有限公司高级经理、建银国际（深圳）有限公司项目经理、平安信托有限公司产品经理。2016 年 12 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2020 年 5 月起任诺安增利债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。 |
| 谢志华 | 本基金基金经理 | 2013 年 12 月<br>28 日 | 2021 年<br>11 月 13 日 | 16 年       | 理学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于                                                                                                                                                        |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司，从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于 2010 年 8 月至 2012 年 8 月任招商安心收益债券基金经理，2011 年 3 月至 2012 年 8 月任招商安瑞进取债券基金经理。2012 年 8 月加入诺安基金管理有限公司，历任投资经理、公司总经理助理、固定收益事业部总经理。2013 年 11 月至 2016 年 2 月任诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理，2015 年 3 月至 2016 年 2 月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券基金经理，2013 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安信用债券一年定期开放债券基金经理，2014 年 6 月至 2016 年 3 月任诺安永鑫收益一年定期开放债券基金经理，2013 年 8 月至 2016 年 3 月任诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理，2014 年 11 月至 2017 年 6 月任诺安保本混合基金经理，2015 年 12 月至 2017 年 12 月任诺安利鑫保本混合及诺安景鑫保本混合基金经理，2016 年 1 月至 2018 年 1 月任诺安益鑫保本混合基金经理，2016 年 2 月至 2018 年 3 月任诺安安鑫保本混合基金经理，2017 年 12 月至 2018</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 年1月任诺安利鑫混合基金经理，2016年4月至2018年5月任诺安和鑫保本混合基金经理，2014年11月至2018年6月任诺安汇鑫保本混合基金经理，2017年12月至2018年7月任诺安景鑫混合基金经理，2017年6月至2019年1月任诺安行业轮动混合基金经理，2013年5月至2019年6月任诺安鸿鑫保本混合基金经理，2013年5月至2021年11月任诺安纯债定期开放债券基金经理，2013年12月至2021年11月任诺安优化收益债券基金经理，2014年11月至2021年11月任诺安聚利债券基金经理，2016年2月至2021年11月任诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理，2018年5月至2021年11月任诺安天天宝货币基金经理，2018年7月至2021年11月任诺安汇利混合基金经理，2019年3月至2021年11月任诺安鼎利混合基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：①此处基金经理的任职日期、离职日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 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，诺安优化收益债券型证券投资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《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》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。

#### 4.3.3 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

回顾 2021 年，全球疫情仍在持续反复，海外国家在群体免疫的策略下，疫情呈现反复大规模爆发，全球供应链受此影响，阻点频发，供给不畅；另一方面，疫情对全球经济恢复形成制约，各国经济复苏程度不平衡，发达国家采取不同程度的货币财政刺激政策，经济得以快速恢复并实现高增长，但由于劳动力及供应链问题，高增长同时亦伴随着高通胀。

国内经济则呈现结构分化特征，较好的疫情管控措施叠加完备的供应链体系下，出口持续高增长，进而带动制造业投资快速增长；消费受疫情反复影响下，表现较为低迷，恢复较慢；此外，在宏观政策更强调跨周期调节下，政府对防风险、调结构诉求提升，要求严控地方债务并加强房地产调控，因此全年基建投资较弱，房地产投资下滑较快；通胀方面，PPI 走高，CPI 低位趋稳，PPI-CPI 剪刀差创新高；货币政策保持稳中偏松、且以我为主。

市场方面，债市上半年在资金面宽松及欠配压力牵引下利率震荡下行，下半年在经济下行及货币宽松影响下，利率趋势下行，全年债市大涨；而权益市场则更关注业绩增长，呈现震荡结构性行情，小盘成长表现好于大盘成长；转债跟随权益市场亦有不错表现，但估值整体偏贵。

策略上，组合采取宏观自上而下与自下而上相结合的方法进行资产配置，转债通过结合自身性价比及正股基本面两方面进行筛选投资；信用债以中高等级品种为主。

操作上，组合根据市场变化，对转债及纯债的仓位进行了调整，年初主要以转债为主，三季度后降低了转债仓位，提高了信用债仓位。

### 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 1.8155 元，本报告期内基金份额净值增长率为 19.84%，同期业绩比较基准收益率为 5.23%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，出口短期仍具韧性，未来随着疫情缓和、欧美等国商品需求向服务消费切换以及全球供应链修复，大概率将会回落；制造业投资未来随着出口放缓，预计总量亦将放缓；地产投资短期继续回落，稳增长诉求下，后续随着地产政策边际放松以及保障房等托底政策推出，未来有望触底企稳；基建投资预计将是重要发力点，12 月中央经济工作会议释放“适度超前开展基础设施投资”信号，随着财政大量结余资金、地方专项债资金落地以及地方政府人事换届完成，基建投资仍有进一步上行空间；消费短期在疫情影响下，难言有大的反弹，长期来看随着经济恢复及疫情缓和，消费仍有恢复空间。货币政策，央行已释放较强的宽货币信号，包括 MLF、OMO 及 SLF 利率下调，引

导 LPR 利率下降，以及一些结构性宽信用政策，预计未来货币政策继续保持稳中偏松；海外方面，美联储释放鹰派信号，未来或有加息及缩表，全球央行货币政策也同样释放收紧预期。

综合来看，虽然经济基本面仍将惯性下行，且货币政策偏松，宏观背景目前仍有利于债市；但政策端已开始调整，稳增长诉求提前，地产纠偏及稳增长相关政策陆续推出；宽货币政策终将向宽信用传导，结构性的宽信用政策效力也将逐步显现，考虑到前期债市利率下行较多，继续追涨性价比不高，未来预计债市受宽信用预期扰动，短期维持底部震荡；权益方面预计仍以结构性机会为主，可转债估值偏贵，总体偏谨慎，未来将主要依托转债特性，结合转债与正股考量，来寻求投资机会。

未来需关注政策落地情况、通胀演绎、全球疫情进展及美联储货币政策收紧风险。

#### 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，基金管理人对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，本基金管理人所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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经

本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同约定,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六次,如当期出现净亏损,则不进行收益分配。

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**

本报告期内,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**

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,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份额持有人利益的行为。

#### **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**

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年年度报告中的财务指标、净值

表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 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                 |
| 报告编号       | 普华永道中天审字(2022)第 23022 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         | 诺安优化收益债券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>我们审计了诺安优化收益债券型证券投资基金(以下简称“诺安优化收益债券基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)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,公允反映了诺安优化收益债券基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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,我们独立于诺安优化收益债券基金,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            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>诺安优化收益债券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优化收益债券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优化收益债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>                                                                    |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 基金管理人治理层负责监督诺安优化收益债券基金的财务报告过程。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 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，就可能导致对诺安优化收益债券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优化收益债券基金不能持续经营。</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        | 薛竞, 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          | 2022 年 03 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 26,239,318.32                   | 6,135,589.13                     |
| 结算备付金           |            | 10,789,544.93                   | 8,057,421.34                     |
| 存出保证金           |            | 300,172.27                      | 306,363.77                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,862,140,676.32                | 1,243,571,846.74                 |
| 其中：股票投资         |            | -                               | 123,191,239.31                   |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 1,862,140,676.32                | 1,120,380,607.43                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 190,000,000.00                  | 50,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 3,141,639.03                    | 16,477,305.88                    |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 9,267,683.09                    | 6,001,302.99                     |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 6,597,312.41                    | 442,939.22                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 2,108,476,346.37                | 1,330,992,769.07                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | -                               | 65,000,000.00                    |
| 应付证券清算款         |            | 1,979,058.39                    | 11,945,895.43                    |
| 应付赎回款           |            | 2,538,231.78                    | 2,762,231.62                     |
| 应付管理人报酬         |            | 1,191,738.94                    | 720,863.72                       |
| 应付托管费           |            | 306,447.15                      | 185,364.99                       |
| 应付销售服务费         |            | 476,695.60                      | 288,345.50                       |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 3,764.24                        | 273,996.32                       |
| 应交税费            |            | 1,642,862.73                    | 1,621,832.27                     |
| 应付利息            |            | -                               | -43,770.85                       |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                               | -                                |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 220,385.47                      | 48,283.33                        |
| 负债合计            |            | 8,359,184.30                    | 82,803,042.33                    |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                               | -                                |

|            |          |                  |                  |
|------------|----------|------------------|------------------|
| 实收基金       | 7.4.7.9  | 1,156,749,419.54 | 823,921,193.03   |
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | 943,367,742.53   | 424,268,533.71   |
| 所有者权益合计    |          | 2,100,117,162.07 | 1,248,189,726.74 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 2,108,476,346.37 | 1,330,992,769.07 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8155 元，基金份额总额 1,156,749,419.54 份。

## 7.2 利润表

会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2021 年 01 月 01<br>日至 2021 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日<br>至 2020 年 12 月 31<br>日 |
|----------------------------|------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 240,359,745.28                                 | 173,716,390.61                                       |
| 1. 利息收入                    |            | 14,626,662.58                                  | 10,913,082.84                                        |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 318,638.82                                     | 241,752.93                                           |
| 债券利息收入                     |            | 12,941,348.33                                  | 10,323,106.50                                        |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                              | -                                                    |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 1,366,675.43                                   | 348,223.41                                           |
| 证券出借利息收入                   |            | -                                              | -                                                    |
| 其他利息收入                     |            | -                                              | -                                                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 185,385,574.68                                 | 157,011,920.43                                       |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 59,763,620.35                                  | 32,197,062.53                                        |
| 基金投资收益                     |            | -                                              | -                                                    |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 124,823,715.86                                 | 124,427,432.26                                       |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -                                              | -                                                    |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -                                              | -                                                    |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15   | -                                              | -                                                    |
| 股利收益                       | 7.4.7.16   | 798,238.47                                     | 387,425.64                                           |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 40,083,274.09                                  | 5,306,053.69                                         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                                              | -                                                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.18   | 264,233.93                                     | 485,333.65                                           |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 18,456,100.50                                  | 13,827,424.40                                        |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 9,009,219.65                                   | 6,663,421.88                                         |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 2,316,656.42                                   | 1,713,451.35                                         |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 3,603,687.98                                   | 2,665,368.78                                         |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 973,337.31                                     | 858,648.92                                           |
| 5. 利息支出                    |            | 2,266,101.00                                   | 1,652,982.60                                         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,266,101.00                                   | 1,652,982.60                                         |
| 6. 税金及附加                   |            | 30,598.14                                      | 28,350.87                                            |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 256,500.00                                     | 245,200.00                                           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 221,903,644.78                                 | 159,888,966.21                                       |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 221,903,644.78 | 159,888,966.21 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安优化收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日      |                 |                   |
|----------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                          | 未分配<br>利润       | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 823,921,193.03                                | 424,268,533.71  | 1,248,189,726.74  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                             | 221,903,644.78  | 221,903,644.78    |
| 三、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）      | 332,828,226.51                                | 297,195,564.04  | 630,023,790.55    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,292,630,560.86                              | 872,549,975.27  | 2,165,180,536.13  |
| 2. 基金赎回款                               | -959,802,334.35                               | -575,354,411.23 | -1,535,156,745.58 |
| 四、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） | -                                             | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,156,749,419.54                              | 943,367,742.53  | 2,100,117,162.07  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日 |                 |                   |
|                                        | 实收基金                                          | 未分配<br>利润       | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 402,972,424.48                                | 88,851,699.52   | 491,824,124.00    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                             | 159,888,966.21  | 159,888,966.21    |
| 三、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）      | 420,948,768.55                                | 175,527,867.98  | 596,476,636.53    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,599,017,010.95                              | 597,890,752.94  | 2,196,907,763.89  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,178,068,242.40                             | -422,362,884.96 | -1,600,431,127.36 |
| 四、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） | -                                             | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 823,921,193.03                                | 424,268,533.71  | 1,248,189,726.74  |

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

基金管理人负责人

田冲

主管会计工作负责人

薛有为

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

诺安优化收益债券型证券投资基金(原诺安中短期债券投资基金,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〔2006〕115号《关于同意诺安中短期债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《诺安中短期债券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,405,149,318.00元。经向中国证监会备案,《诺安中短期债券投资基金基金合同》于2006年7月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,405,401,965.36份,其中认购资金利息折合252,647.36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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据中国证监会证监基金字〔2007〕239号《关于核准诺安中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》及本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于2007年8月29日发布的《诺安中短债(320004)基金份额持有人大会决议生效公告》,于2007年7月10日至8月9日以通讯方式召开的基金份额持有人大会审议通过了《关于诺安中短期债券投资基金转型为诺安优化收益债券型证券投资基金有关事项的议案》。经与基金托管人协商一致,基金管理人已将《诺安中短期债券投资基金基金合同》修订为《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》,《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》自2017年8月29日起生效,原《诺安中短期债券投资基金基金合同》自同一起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债(包括可转债、可交换债)、资产支持证券、银行存款、同业存单、回购、货币市场工具等固定收益类金融工具,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有因可转债或可交换债转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产,但非固定收益类金融工具投资比例合计不超过基金资产的20%,因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。本基金不通过二级市场买入股票或权证。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数。

### 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《诺安优化收益债券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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值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

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

#### 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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、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。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他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) 每一基金份额享有同等收益分配权；
- (b) 投资者可以选择现金分红或红利再投资。若基金份额持有人未做选择，则默认对其收益的分配方式为现金分红；
- (c) 如果基金份额持有人所获现金红利不足支付银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利转为基金份额；
- (d) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (e) 基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；
- (f) 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六次；
- (g) 本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (h) 以不损害基金份额持有人利益为前提，基金管理人可以无需基金份额持有人大会审议通过酌情调整基金收益分配方案；
- (i) 法律、法规或监管机关另有规定的，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，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(可转换债券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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(可转换债券和私募债券除外)，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。

(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 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 26,239,318.32      | 6,135,589.13        |
| 定期存款         | —                  | —                   |
| 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        | -                | -               |
| 合计          | 26, 239, 318. 32 | 6, 135, 589. 13 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |                      |                  |
|---------------|-------|--------------------------|----------------------|------------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值                 | 公允价值变动           |
| 股票            |       | -                        | -                    | -                |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                    | -                |
| 债券            | 交易所市场 | 1, 281, 749, 518. 48     | 1, 342, 062, 276. 32 | 60, 312, 757. 84 |
|               | 银行间市场 | 518, 549, 365. 94        | 520, 078, 400. 00    | 1, 529, 034. 06  |
|               | 合计    | 1, 800, 298, 884. 42     | 1, 862, 140, 676. 32 | 61, 841, 791. 90 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                    | -                |
| 基金            |       | -                        | -                    | -                |
| 其他            |       | -                        | -                    | -                |
| 合计            |       | 1, 800, 298, 884. 42     | 1, 862, 140, 676. 32 | 61, 841, 791. 90 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                      |                  |
|               |       | 成本                       | 公允价值                 | 公允价值变动           |
| 股票            |       | 126, 074, 063. 00        | 123, 191, 239. 31    | -2, 882, 823. 69 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                    | -                |
| 债券            | 交易所市场 | 922, 612, 429. 95        | 948, 373, 607. 43    | 25, 761, 177. 48 |
|               | 银行间市场 | 173, 126, 835. 98        | 172, 007, 000. 00    | -1, 119, 835. 98 |
|               | 合计    | 1, 095, 739, 265. 93     | 1, 120, 380, 607. 43 | 24, 641, 341. 50 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                    | -                |
| 基金            |       | -                        | -                    | -                |
| 其他            |       | -                        | -                    | -                |
| 合计            |       | 1, 221, 813, 328. 93     | 1, 243, 571, 846. 74 | 21, 758, 517. 81 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 190,000,000.00           | —         |
| 银行间市场 | —                        | —         |
| 合计    | 190,000,000.00           | —         |
| 项目    | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 50,000,000.00            | —         |
| 银行间市场 | —                        | —         |
| 合计    | 50,000,000.00            | —         |

#### 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,840.62                | 532.54                   |
| 应收定期存款利息   | —                       | —                        |
| 应收其他存款利息   | —                       | —                        |
| 应收结算备付金利息  | 4,855.30                | 3,625.80                 |
| 应收债券利息     | 9,326,677.68            | 5,997,006.75             |
| 应收资产支持证券利息 | —                       | —                        |
| 应收买入返售证券利息 | -66,825.61              | —                        |
| 应收申购款利息    | —                       | —                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                       | —                        |
| 应收出借证券利息   | —                       | —                        |
| 其他         | 135.10                  | 137.90                   |
| 合计         | 9,267,683.09            | 6,001,302.99             |

注：此处“其他”列示的是应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------|

|             |          |            |
|-------------|----------|------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -        | 272,953.79 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,764.24 | 1,042.53   |
| 合计          | 3,764.24 | 273,996.32 |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 1,085.47           | 283.33              |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 预提费用        | 219,300.00         | 48,000.00           |
| 合计          | 220,385.47         | 48,283.33           |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额             |
| 上年度末          | 823,921,193.03                | 823,921,193.03   |
| 本期申购          | 1,292,630,560.86              | 1,292,630,560.86 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -959,802,334.35               | -959,802,334.35  |
| 本期末           | 1,156,749,419.54              | 1,156,749,419.54 |

注：此处申购含红利再投资、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.10 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           | 235,068,431.19  | 189,200,102.52  | 424,268,533.71  |
| 本期利润           | 181,820,370.69  | 40,083,274.09   | 221,903,644.78  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 185,858,773.11  | 111,336,790.93  | 297,195,564.04  |
| 其中：基金申购款       | 535,315,461.78  | 337,234,513.49  | 872,549,975.27  |
| 基金赎回款          | -349,456,688.67 | -225,897,722.56 | -575,354,411.23 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 602,747,574.99  | 340,620,167.54  | 943,367,742.53  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|----|-------------------------------|------------------------------------|
|----|-------------------------------|------------------------------------|

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 活期存款利息收入  | 124,632.29 | 93,899.94  |
| 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 | 159,240.31 | 52,039.47  |
| 其他        | 34,766.22  | 95,813.52  |
| 合计        | 318,638.82 | 241,752.93 |

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。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 437,405,656.83                | 379,467,846.26                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 377,642,036.48                | 347,270,783.73                     |
| 买卖股票差价收入   | 59,763,620.35                 | 32,197,062.53                      |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12<br>月31日 |
|-------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,185,813,573.49                  | 1,952,818,935.44                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,054,343,378.57                  | 1,822,273,378.48                       |
| 减：应收利息总额                | 6,646,479.06                      | 6,118,124.70                           |
| 买卖债券差价收入                | 124,823,715.86                    | 124,427,432.26                         |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 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。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12<br>月31日 |
|---------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 798,238.47                        | 387,425.64                             |
| 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            | 798,238.47                        | 387,425.64                             |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年01月01日至2021年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12<br>月31日 |
|----------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 40,083,274.09                     | 5,306,053.69                           |
| --股票投资                     | 2,882,823.69                      | -2,882,823.69                          |
| --债券投资                     | 37,200,450.40                     | 8,188,877.38                           |
| --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<br>变动产生的预估增值税 | -                                 | -                                      |
| 合计                         | 40,083,274.09                     | 5,306,053.69                           |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31<br>日 |
|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 255,960.89                        | 440,826.34                             |
| 基金转换费收入 | 8,273.04                          | 44,507.31                              |
| 合计      | 264,233.93                        | 485,333.65                             |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月<br>31日 |
|----|-----------------------------------|----------------------------------------|
|----|-----------------------------------|----------------------------------------|

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 交易所市场交易费用 | 967,414.81 | 851,243.92 |
| 银行间市场交易费用 | 5,922.50   | 7,405.00   |
| 合计        | 973,337.31 | 858,648.92 |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---------|-------------------------------|------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                     | 48,000.00                          |
| 信息披露费   | 120,000.00                    | 160,000.00                         |
| 证券出借违约金 | -                             | -                                  |
| 账户维护费   | 46,500.00                     | 37,200.00                          |
| 合计      | 256,500.00                    | 245,200.00                         |

#### 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，本基金并无需要作披露的或有事项。

##### 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 |
| 华夏银行股份有限公司     | 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         |
| 诺安国际资产管理有限公司   | 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<br>2021年01月01日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020<br>年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,009,219.65                      | 6,663,421.88                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,603,596.44                      | 1,084,399.69                           |

注：本基金的管理费率为年费率 0.70%。

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：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,316,656.42                      | 1,713,451.35                           |

注：本基金的托管费率为年费率 0.18%。

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：

$$H=E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |
| 诺安基金管理有限公司     | 1,540,281.33                  |

|                |                                    |
|----------------|------------------------------------|
| 华夏银行股份有限公司     | 70,202.07                          |
| 合计             | 1,610,483.40                       |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |
| 诺安基金管理有限公司     | 1,259,831.57                       |
| 华夏银行股份有限公司     | 49,723.38                          |
| 合计             | 1,309,554.95                       |

注：本基金的销售服务费费率为年费率 0.28%。

基金销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内与上年度可比期间均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<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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    |
| 华夏银行股份有限公司 | 26,239,318.32                 | 124,632.29 | 6,135,589.13                       | 93,899.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏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2021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：债券 |      |             |             |        |        |        |              |              |              |    |
|----------------------|------|-------------|-------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日        | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：张) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 113052               | 兴业转债 | 2021年12月29日 | 2022年01月14日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 20,210       | 2,021,000.00 | 2,021,000.00 |    |

注：上述流通受限证券的可流通日期以上市公司公告为准。

##### 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**

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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华夏银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 9,969,000.00       | -                   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 259,277,100.00     | 7,109,289.00        |
| 合计     | 269,246,100.00     | 7,109,289.00        |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资券等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 632,257,323.69     | 185,687,657.84      |
| AAA 以下 | 836,721,352.63     | 867,223,660.59      |
| 未评级    | 123,915,900.00     | 60,360,000.00       |
| 合计     | 1,592,894,576.32   | 1,113,271,318.43    |

注：未评级债券为中期票据、政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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于约定开放日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于开放期内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 2021 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2021 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 2021 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 12 月<br>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                       | 26, 239, 318.32 | -        | -     | -     | -   | 26, 239, 318.32 |

|                     |                |               |                  |                |               |                  |
|---------------------|----------------|---------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 结算备付金               | 10,789,544.93  | -             | -                | -              | -             | 10,789,544.93    |
| 存出保证金               | 300,172.27     | -             | -                | -              | -             | 300,172.27       |
| 交易性金融资产             | 247,598,180.00 | 94,135,100.00 | 1,112,316,914.09 | 408,090,482.23 | -             | 1,862,140,676.32 |
| 买入返售金融资产            | 190,000,000.00 | -             | -                | -              | -             | 190,000,000.00   |
| 应收证券清算款             | -              | -             | -                | -              | 3,141,639.03  | 3,141,639.03     |
| 应收利息                | -              | -             | -                | -              | 9,267,683.09  | 9,267,683.09     |
| 应收申购款               | 2,070.00       | -             | -                | -              | 6,595,242.41  | 6,597,312.41     |
| 资产总计                | 474,929,285.52 | 94,135,100.00 | 1,112,316,914.09 | 408,090,482.23 | 19,004,564.53 | 2,108,476,346.37 |
| 负债                  |                |               |                  |                |               |                  |
| 应付证券清算款             | -              | -             | -                | -              | 1,979,058.39  | 1,979,058.39     |
| 应付赎回款               | -              | -             | -                | -              | 2,538,231.78  | 2,538,231.78     |
| 应付管理人报酬             | -              | -             | -                | -              | 1,191,738.94  | 1,191,738.94     |
| 应付托管费               | -              | -             | -                | -              | 306,447.15    | 306,447.15       |
| 应付销售服务费             | -              | -             | -                | -              | 476,695.60    | 476,695.60       |
| 应付交易费用              | -              | -             | -                | -              | 3,764.24      | 3,764.24         |
| 应交税费                | -              | -             | -                | -              | 1,642,862.73  | 1,642,862.73     |
| 其他负债                | -              | -             | -                | -              | 220,385.47    | 220,385.47       |
| 负债总计                | -              | -             | -                | -              | 8,359,184.30  | 8,359,184.30     |
| 利率敏感度缺口             | 474,929,285.52 | 94,135,100.00 | 1,112,316,914.09 | 408,090,482.23 | 10,645,380.23 | 2,100,117,162.07 |
| 上年度末<br>2020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                | 6,135,589.13   | -             | -                | -              | -             | 6,135,589.13     |
| 结算备付金               | 8,057,421.34   | -             | -                | -              | -             | 8,057,421.34     |
| 存出保证金               | 306,363.77     | -             | -                | -              | -             | 306,363.77       |

|           |                |               |                |                |                |                  |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 交易性金融资产   | 71,499,289.00  | 19,364,000.00 | 377,516,696.87 | 652,000,621.56 | 123,191,239.31 | 1,243,571,846.74 |
| 买入返售金融资产  | 50,000,000.00  | —             | —              | —              | —              | 50,000,000.00    |
| 应收证券清算款   | —              | —             | —              | —              | 16,477,305.88  | 16,477,305.88    |
| 应收利息      | —              | —             | —              | —              | 6,001,302.99   | 6,001,302.99     |
| 应收申购款     | 100.00         | —             | —              | —              | 442,839.22     | 442,939.22       |
| 资产总计      | 135,998,763.24 | 19,364,000.00 | 377,516,696.87 | 652,000,621.56 | 146,112,687.40 | 1,330,992,769.07 |
| 负债        |                |               |                |                |                |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 65,000,000.00  | —             | —              | —              | —              | 65,000,000.00    |
| 应付证券清算款   | —              | —             | —              | —              | 11,945,895.43  | 11,945,895.43    |
| 应付赎回款     | —              | —             | —              | —              | 2,762,231.62   | 2,762,231.62     |
| 应付管理人报酬   | —              | —             | —              | —              | 720,863.72     | 720,863.72       |
| 应付托管费     | —              | —             | —              | —              | 185,364.99     | 185,364.99       |
| 应付销售服务费   | —              | —             | —              | —              | 288,345.50     | 288,345.50       |
| 应付交易费用    | —              | —             | —              | —              | 273,996.32     | 273,996.32       |
| 应付利息      | —              | —             | —              | —              | -43,770.85     | -43,770.85       |
| 应交税费      | —              | —             | —              | —              | 1,621,832.27   | 1,621,832.27     |
| 其他负债      | —              | —             | —              | —              | 48,283.33      | 48,283.33        |
| 负债总计      | 65,000,000.00  | —             | —              | —              | 17,803,042.33  | 82,803,042.33    |
| 利率敏感度缺口   | 70,998,763.24  | 19,364,000.00 | 377,516,696.87 | 652,000,621.56 | 128,309,645.07 | 1,248,189,726.74 |

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

| 假设 | 除市场利率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(2021年12月31日)            | 上年度末(2020年12月31日) |
|    | 市场利率下降27个基点        | 16,233,478.37               | 13,173,990.38     |
|    | 市场利率上升27个基点        | -16,233,478.37              | -13,173,990.38    |

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：非固定收益类金融工具投资比例合计不超过基金资产的 20%。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<br>2021 年 12 月 31 日 |                   | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净<br>值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | —                       | —                 | 123,191,239.31           | 9.87              |
| 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            | —                       | —                 | 123,191,239.31           | 9.87              |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资（2020 年 12 月 31 日：本基金持有

的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 9.87%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 1,278,542,030.12 元，属于第二层次的余额为 583,598,646.20 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 1,035,086,090.54 元，属于第二层次的余额为 208,485,756.20 元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 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股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具相关会计准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具相关会计准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具相关会计准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

(3) 除公允价值和执行新金融工具相关会计准则外,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              | —                | —            |
|    | 其中:股票             | —                | —            |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,862,140,676.32 | 88.32        |
|    | 其中:债券             | 1,862,140,676.32 | 88.32        |
|    | 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          | 190,000,000.00   | 9.01         |
|    | 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      | 37,028,863.25    | 1.76         |
| 8  | 其他各项资产            | 19,306,806.80    | 0.92         |
| 9  | 合计                | 2,108,476,346.37 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

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  | 601012 | 隆基股份 | 65,361,636.60 | 5.24           |
| 2  | 002241 | 歌尔股份 | 38,244,383.10 | 3.06           |
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 34,928,565.84 | 2.80           |
| 4  | 002460 | 赣锋锂业 | 32,282,864.85 | 2.59           |
| 5  | 002831 | 裕同科技 | 20,286,116.40 | 1.63           |
| 6  | 601233 | 桐昆股份 | 16,764,864.00 | 1.34           |
| 7  | 603690 | 至纯科技 | 16,099,470.90 | 1.29           |
| 8  | 603939 | 益丰药房 | 13,087,456.07 | 1.05           |
| 9  | 601615 | 明阳智能 | 7,367,625.00  | 0.59           |
| 10 | 603136 | 天目湖  | 4,418,913.52  | 0.35           |
| 11 | 300618 | 寒锐钴业 | 2,726,077.20  | 0.22           |

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  | 601012 | 隆基股份 | 94,462,877.99 | 7.57           |
| 2  | 002311 | 海大集团 | 49,724,937.79 | 3.98           |
| 3  | 002460 | 赣锋锂业 | 49,262,448.91 | 3.95           |
| 4  | 002241 | 歌尔股份 | 46,301,083.21 | 3.71           |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 41,985,271.60 | 3.36           |
| 6  | 603916 | 苏博特  | 27,798,538.78 | 2.23           |
| 7  | 603659 | 璞泰来  | 25,432,952.00 | 2.04           |
| 8  | 601233 | 桐昆股份 | 22,758,470.92 | 1.82           |
| 9  | 002831 | 裕同科技 | 20,624,421.01 | 1.65           |
| 10 | 603690 | 至纯科技 | 13,401,275.33 | 1.07           |
| 11 | 603939 | 益丰药房 | 11,393,122.06 | 0.91           |
| 12 | 002727 | 一心堂  | 10,570,631.25 | 0.85           |
| 13 | 601615 | 明阳智能 | 6,995,752.50  | 0.56           |
| 14 | 002641 | 公元股份 | 6,746,251.62  | 0.54           |
| 15 | 603136 | 天目湖  | 4,027,987.19  | 0.32           |
| 16 | 603180 | 金牌厨柜 | 3,681,811.67  | 0.29           |
| 17 | 300618 | 寒锐钴业 | 2,237,823.00  | 0.18           |

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 | 251,567,973.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 437,405,656.83 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 90,043,000.00    | 4.29         |
|    | 其中：政策性金融债 | 90,043,000.00    | 4.29         |
| 4  | 企业债券      | 20,126,000.00    | 0.96         |
| 5  | 企业短期融资券   | 179,203,100.00   | 8.53         |
| 6  | 中期票据      | 250,832,300.00   | 11.94        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,321,936,276.32 | 62.95        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,862,140,676.32 | 88.67        |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张）   | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|----------------|--------------|
| 1  | 123111 | 东财转3 | 660,000 | 110,998,800.00 | 5.29         |
| 2  | 127005 | 长证转债 | 672,025 | 85,743,669.75  | 4.08         |
| 3  | 110053 | 苏银转债 | 566,210 | 67,016,615.60  | 3.19         |
| 4  | 113011 | 光大转债 | 567,520 | 63,573,590.40  | 3.03         |
| 5  | 110073 | 国投转债 | 534,030 | 61,872,715.80  | 2.95         |

## 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.3 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   | 300,172.27    |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,141,639.03  |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 9,267,683.09  |
| 5  | 应收申购款   | 6,597,312.41  |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 19,306,806.80 |

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1  | 123111 | 东财转3 | 110,998,800.00 | 5.29         |
| 2  | 127005 | 长证转债 | 85,743,669.75  | 4.08         |

|    |        |          |               |      |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 3  | 110053 | 苏银转债     | 67,016,615.60 | 3.19 |
| 4  | 113011 | 光大转债     | 63,573,590.40 | 3.03 |
| 5  | 110073 | 国投转债     | 61,872,715.80 | 2.95 |
| 6  | 113026 | 核能转债     | 49,987,050.00 | 2.38 |
| 7  | 110047 | 山鹰转债     | 44,971,548.80 | 2.14 |
| 8  | 132018 | G 三峡 EB1 | 36,374,000.00 | 1.73 |
| 9  | 113009 | 广汽转债     | 35,230,980.00 | 1.68 |
| 10 | 127006 | 敖东转债     | 33,356,192.04 | 1.59 |
| 11 | 110079 | 杭银转债     | 31,135,000.00 | 1.48 |
| 12 | 113606 | 荣泰转债     | 30,100,237.50 | 1.43 |
| 13 | 113050 | 南银转债     | 28,326,991.20 | 1.35 |
| 14 | 127020 | 中金转债     | 25,890,261.69 | 1.23 |
| 15 | 113013 | 国君转债     | 25,723,360.00 | 1.22 |
| 16 | 111000 | 起帆转债     | 24,476,189.60 | 1.17 |
| 17 | 113048 | 晶科转债     | 22,624,539.00 | 1.08 |
| 18 | 128048 | 张行转债     | 22,219,657.70 | 1.06 |
| 19 | 110067 | 华安转债     | 21,251,662.60 | 1.01 |
| 20 | 128133 | 奇正转债     | 21,097,035.92 | 1.00 |
| 21 | 113616 | 韦尔转债     | 20,597,260.00 | 0.98 |
| 22 | 128034 | 江银转债     | 18,917,507.70 | 0.90 |
| 23 | 127024 | 盈峰转债     | 15,803,738.72 | 0.75 |
| 24 | 128134 | 鸿路转债     | 14,991,000.00 | 0.71 |
| 25 | 128129 | 青农转债     | 13,406,580.00 | 0.64 |
| 26 | 128107 | 交科转债     | 12,474,408.96 | 0.59 |
| 27 | 113046 | 金田转债     | 11,984,000.00 | 0.57 |
| 28 | 113598 | 法兰转债     | 11,535,583.70 | 0.55 |
| 29 | 113610 | 灵康转债     | 11,353,011.20 | 0.54 |
| 30 | 113044 | 大秦转债     | 11,162,880.00 | 0.53 |
| 31 | 123087 | 明电转债     | 10,797,600.00 | 0.51 |
| 32 | 113049 | 长汽转债     | 10,716,300.00 | 0.51 |
| 33 | 113621 | 彤程转债     | 10,476,159.30 | 0.50 |
| 34 | 127033 | 中装转 2    | 9,200,370.96  | 0.44 |
| 35 | 110060 | 天路转债     | 9,151,929.60  | 0.44 |
| 36 | 128109 | 楚江转债     | 8,873,228.18  | 0.42 |
| 37 | 123100 | 朗科转债     | 8,336,439.09  | 0.40 |
| 38 | 113542 | 好客转债     | 7,900,200.00  | 0.38 |
| 39 | 110068 | 龙净转债     | 7,829,500.00  | 0.37 |
| 40 | 128136 | 立讯转债     | 7,571,906.55  | 0.36 |
| 41 | 123049 | 维尔转债     | 7,560,800.00  | 0.36 |
| 42 | 113504 | 艾华转债     | 7,362,685.20  | 0.35 |
| 43 | 127027 | 靖远转债     | 7,292,580.00  | 0.35 |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 44 | 113051 | 节能转债     | 7,221,200.00 | 0.34 |
| 45 | 127026 | 超声转债     | 7,110,875.83 | 0.34 |
| 46 | 127029 | 中钢转债     | 7,031,220.00 | 0.33 |
| 47 | 123022 | 长信转债     | 6,246,750.00 | 0.30 |
| 48 | 123112 | 万讯转债     | 5,808,784.03 | 0.28 |
| 49 | 128105 | 长集转债     | 5,582,500.00 | 0.27 |
| 50 | 113600 | 新星转债     | 5,468,800.00 | 0.26 |
| 51 | 128135 | 洽洽转债     | 5,259,211.00 | 0.25 |
| 52 | 128145 | 日丰转债     | 5,001,421.27 | 0.24 |
| 53 | 132020 | 19 蓝星 EB | 4,999,246.20 | 0.24 |
| 54 | 113565 | 宏辉转债     | 4,450,680.00 | 0.21 |
| 55 | 113033 | 利群转债     | 4,425,600.00 | 0.21 |
| 56 | 128119 | 龙大转债     | 3,749,171.79 | 0.18 |
| 57 | 110045 | 海澜转债     | 3,743,360.00 | 0.18 |
| 58 | 123073 | 同和转债     | 3,572,400.00 | 0.17 |
| 59 | 123098 | 一品转债     | 3,172,000.00 | 0.15 |
| 60 | 110043 | 无锡转债     | 2,994,250.00 | 0.14 |
| 61 | 128141 | 旺能转债     | 2,776,828.08 | 0.13 |
| 62 | 113609 | 永安转债     | 2,708,600.00 | 0.13 |
| 63 | 128081 | 海亮转债     | 2,678,200.00 | 0.13 |
| 64 | 128021 | 兄弟转债     | 2,516,274.18 | 0.12 |
| 65 | 127012 | 招路转债     | 2,379,600.00 | 0.11 |
| 66 | 110077 | 洪城转债     | 2,213,600.00 | 0.11 |
| 67 | 110063 | 鹰 19 转债  | 1,912,320.00 | 0.09 |
| 68 | 123089 | 九洲转 2    | 1,753,700.00 | 0.08 |
| 69 | 123109 | 昌红转债     | 1,584,882.96 | 0.08 |
| 70 | 113608 | 威派转债     | 1,518,654.60 | 0.07 |
| 71 | 113602 | 景 20 转债  | 1,433,500.00 | 0.07 |
| 72 | 113516 | 苏农转债     | 1,189,800.00 | 0.06 |
| 73 | 123108 | 乐普转 2    | 1,182,200.00 | 0.06 |
| 74 | 113037 | 紫银转债     | 1,085,900.00 | 0.05 |
| 75 | 123067 | 斯莱转债     | 1,054,440.00 | 0.05 |
| 76 | 123107 | 温氏转债     | 753,593.34   | 0.04 |
| 77 | 127021 | 特发转 2    | 600,014.80   | 0.03 |
| 78 | 123105 | 拓尔转债     | 509,800.00   | 0.02 |
| 79 | 110057 | 现代转债     | 248,340.00   | 0.01 |

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.11.6 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。

## § 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<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 26,896   | 43,008.23     | 718,882,061.80 | 62.15%     | 437,867,357.74 | 37.85%     |

### 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 | 1,161,345.76 | 0.1004%  |

### 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2007年08月29日）基金份额总额 | 205,321,350.98   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 823,921,193.03   |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,292,630,560.86 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 959,802,334.35   |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 1,156,749,419.54 |

注：① 总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

② 原基金合同生效日（2006年7月17日）基金份额总额1,405,401,965.36份。

## § 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

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

李强先生担任公司董事长、李学君女士担任公司督察长、于东升先生于 2021 年 4 月至 2022 年 1 月期间担任公司副总经理；秦维舟先生不再担任公司董事长、马宏先生不再担任公司督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

本基金托管人 2021 年 8 月 13 日发布公告，国然女士自 2021 年 8 月 9 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

### 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 9 万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司收到深圳证监局关于子公司及相关人员的监管措施，公司按要求落实。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|      | 数量 | 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 |   |
|------|----|----------------|--------------|------------|------------|---|
| 安信证券 | 1  | 409,966,591.97 | 59.50%       | 234,634.35 | 57.60%     | — |
| 湘财证券 | 1  | 279,007,038.34 | 40.50%       | 172,726.20 | 42.40%     | — |

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。
  - （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，与被签订的券商签订《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             |              | 回购交易              |              | 权证交易 |              | 基金   |              |
|------|------------------|--------------|-------------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期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 |
| 安信证券 | 2,218,448,272.70 | 50.76%       | 19,633,000,000.00 | 85.46%       | —    | —            | —    | —            |
| 湘财证券 | 2,152,217,815.78 | 49.24%       | 3,340,900,000.00  | 14.54%       | —    | —            | —    | —            |

## 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基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的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》 | 2021年01月04日 |
| 2  | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告          | 《证券时报》、《上海证券报》、               | 2021年01月04日 |

|    |                                                       |                                           |                  |
|----|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------|
|    |                                                       | 《中国证券报》、<br>《证券日报》                        |                  |
| 3  | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金费率优惠活动的公告                | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 01 月 05 日 |
| 4  | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加烟台银行基金申购费率优惠活动的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 01 月 06 日 |
| 5  | 诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告                | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 01 月 16 日 |
| 6  | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                        | 基金管理人网站                                   | 2021 年 01 月 22 日 |
| 7  | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 01 月 22 日 |
| 8  | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿为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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 02 月 08 日 |
| 9  | 诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告              | 基金管理人网站                                   | 2021 年 02 月 08 日 |
| 10 | 诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购费率优惠活动的公告          | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 03 月 12 日 |
| 11 | 诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告              | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 03 月 29 日 |
| 12 | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2020 年年度报告                            | 基金管理人网站                                   | 2021 年 03 月 31 日 |
| 13 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告                        | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 03 月 31 日 |
| 14 | 诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告      | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、           | 2021 年 03 月 31 日 |

|    |                                                               |                                           |                  |
|----|---------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------|
|    |                                                               | 《证券日报》                                    |                  |
| 15 | 诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 04 月 01 日 |
| 16 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵州银行为代销机构并开通定投、转换业务及旗下部分基金参加贵州银行费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 04 月 02 日 |
| 17 | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                                | 基金管理人网站                                   | 2021 年 04 月 22 日 |
| 18 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告                            | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 04 月 22 日 |
| 19 | 诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告                                       | 《中国证券报》                                   | 2021 年 04 月 28 日 |
| 20 | 诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                       | 《中国证券报》                                   | 2021 年 05 月 29 日 |
| 21 | 诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告                              | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 06 月 11 日 |
| 22 | 诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 期                           | 基金管理人网站                                   | 2021 年 06 月 15 日 |
| 23 | 诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议                                           | 基金管理人网站                                   | 2021 年 06 月 15 日 |
| 24 | 诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同                                           | 基金管理人网站                                   | 2021 年 06 月 15 日 |
| 25 | 诺安优化收益债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）                                   | 基金管理人网站                                   | 2021 年 06 月 15 日 |
| 26 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告                          | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 06 月 15 日 |
| 27 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金开展的基金赎回费率优惠活动的公告                      | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 06 月 21 日 |
| 28 | 诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                       | 《上海证券报》                                   | 2021 年 06 月 26 日 |
| 29 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 06 月 30 日 |

|    |                                                         |                                           |                  |
|----|---------------------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------|
| 30 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的基金费率优惠活动的公告                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 06 月 30 日 |
| 31 | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告                          | 基金管理人网站                                   | 2021 年 07 月 21 日 |
| 32 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告                      | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 07 月 21 日 |
| 33 | 诺安优化收益债券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                 | 《证券日报》                                    | 2021 年 08 月 16 日 |
| 34 | 诺安优化收益债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）                             | 基金管理人网站                                   | 2021 年 08 月 16 日 |
| 35 | 诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 2 期                     | 基金管理人网站                                   | 2021 年 08 月 16 日 |
| 36 | 诺安基金管理有限公司关于董事长任职的公告                                    | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 08 月 27 日 |
| 37 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加上海农商行开展的基金费率优惠活动的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》            | 2021 年 08 月 30 日 |
| 38 | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2021 年中期报告                              | 基金管理人网站                                   | 2021 年 08 月 31 日 |
| 39 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告                          | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 08 月 31 日 |
| 40 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 10 月 12 日 |
| 41 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告                      | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 42 | 诺安优化收益债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告                          | 基金管理人网站                                   | 2021 年 10 月 27 日 |
| 43 | 诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加新时代证券开展的基金费率优惠活动的公告                   | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 10 月 29 日 |

|    |                                            |                                           |                  |
|----|--------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------|
| 44 | 诺安基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告                     | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 11 月 01 日 |
| 45 | 诺安基金管理有限公司关于诺安优化收益债券型证券投资基金变更基金经理的公告       | 《证券日报》                                    | 2021 年 11 月 13 日 |
| 46 | 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》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 11 月 17 日 |
| 47 | 诺安优化收益债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）                | 基金管理人网站                                   | 2021 年 11 月 17 日 |
| 48 | 诺安优化收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 3 期        | 基金管理人网站                                   | 2021 年 11 月 17 日 |
| 49 | 诺安基金管理有限公司关于督察长任职的公告                       | 《上海证券报》                                   | 2021 年 12 月 10 日 |
| 50 | 诺安基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金销售相关业务的公告  | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《中国证券报》、<br>《证券日报》 | 2021 年 12 月 14 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者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |
| 机构                                              |                |                         |      |      |      |            |      |
| 个人                                              |                |                         |      |      |      |            |      |
| 产品特有风险                                          |                |                         |      |      |      |            |      |
| 本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。 |                |                         |      |      |      |            |      |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2020 年 8 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，本基金管理人于 2021 年 6 月 15 日披露了《诺安基金管理管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制

并相应修改法律文件的公告》，在本基金基金合同、托管协议中增加了侧袋机制的相关条款，并同步更新了招募说明书、基金产品资料概要，更新后的法律文件同日在本基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站披露。

## § 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原诺安中短期债券投资基金募集的文件。
- ②中国证券监督管理委员会核准原诺安中短期债券投资基金转型为诺安优化收益债券型证券投资基金的批复。
- ③《诺安优化收益债券型证券投资基金基金合同》。
- ④《诺安优化收益债券型证券投资基金托管协议》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安优化收益债券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  
2022年03月31日