

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺安和鑫混合
基金主代码	002560
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月10日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,054,478,838.76份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产的优化配置和个股精选，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金通过积极配置大类资产，动态控制组合风险，并在各大类资产中进行个股、个券精选。以获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资分析</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能</p>

力，选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。

3、固定收益资产投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

4、可转换债券投资策略

本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。

6、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数与中证全债指数的混合指数，即：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)
本期已实现收益	232,629,498.63
本期利润	1,339,433,560.26
加权平均基金份额本期利润	0.2866
本期加权平均净值利润率	19.97%
本期基金份额净值增长率	19.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	-1,028,405,277.33
期末可供分配基金份额利润	-0.2536
期末基金资产净值	7,087,731,590.35
期末基金份额净值	1.7481
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	68.25%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	21.27%	2.64%	-1.13%	0.48%	22.40%	2.16%
过去三个月	38.77%	2.21%	2.68%	0.59%	36.09%	1.62%

过去六个月	19.14%	2.21%	1.31%	0.79%	17.83%	1.42%
过去一年	16.78%	2.39%	16.48%	0.80%	0.30%	1.59%
过去三年	85.36%	2.27%	36.72%	0.81%	48.64%	1.46%
自基金合同生效起至今	68.25%	2.23%	29.50%	0.81%	38.75%	1.42%

注：2018年5月10日（含当日）起，“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。

3.2.2 自基金转型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

诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年05月10日-2021年06月30日)



注：①2018年5月10日（含当日）起，“诺安和鑫保本混合型证券投资基金”转型为本基金，转型后，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。
②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。

§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6月30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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡嵩松	本基金基金经理	2019年03月14日	-	6年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、

					华泰证券股份有限公司，2017年11月加入诺安基金管理有限公司，任研究员。2019年2月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年5月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券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，诺安和鑫灵活配置混合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《诺安和鑫灵活配置混合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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年1月市场的运行延续了2020年底的惯性，表现出了强者恒强的状况，新能源、医药依旧表现强势，科技也在产业高景气度和利空出尽之后有了比较像样的表现；2月春节假期结束后经历了流动性最紧的几天，市场剧烈震动，新能源、军工、半导体等高估值品种出现了较大幅度的调整，静态估值相对较低的光伏、白酒以及顺周期的资源品有明显相对收益；3月随着美债收益率上行，通胀预期和流动性杀估值的逻辑仍在延续，以新能源、半导体为主的高估值品种继续调整，市场对基本面的反应已经失效，静态估值较高的品种杀跌。两市地量交易，成交量连续低于8000亿，机构抱团品种在春节后急跌，底部缩量震荡。

经历了3月份核心资产因为美债收益率上行带来的杀跌之后，4月在印度疫情全面爆发的背景下，市场对社融数据和货币流动性边际变化普遍预期乐观，核心资产也在医药板块的带动下出现了反弹行情；进入5月，几个手机厂商砍单的消息传出，触动了半导体板块中空方的最后一根神经，本轮半导体芯片的景气度全市场有目共睹，但是股价却没有表现出相应的走势，其中市场对于手机厂商重复订单的担忧是主要因素，担忧这轮景气周期的持续性不够，这次的消息传出也是这个利空的落地，因此五一之后，龙头设计厂商领跌。而本轮景气周期的需求端是全面创新周期触发的，现在供货商、渠道商、终端厂商手中的货源一货难求，不是某一项单方面需求能够左右的，因此板块在急跌之后快速修复；随着七一大庆的临近，市场情绪逐渐上行，半导体芯片产业端持续高景气度，国产替代方面，关键核心要素进展超预期，6月中旬以芯片为首的科技板块全面爆发，而后随着芯片公司的中报业绩预告拉开序幕，超高的业绩增速彻底点燃市场，市场对我们之前提到的产业的高景气与股价的剪刀差越来越大的修复进行了完美演绎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期，末诺安和鑫混合基金份额净值为1.7481元；本报告期内，基金份额净值增长率为19.14%，同期业绩比较基准收益率为1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，本轮半导体行业的景气度根源在于5G带来的创新周期，创新需求侧的提升是线性向上的，而产能资本开支的扩张是非线性的，这就导致了供给侧和需求侧的矛盾。而新冠疫情、美国对中国科技的封锁等因素又使之加剧，短期之内这一矛盾无法缓解，只能在新增产能陆续达产之后再动态观察供需关系。因此，半导体芯片的这轮景气度，时间维度很可能超预期。另外，随着国产相关技术产品陆续攻克，国产替代的加速推进这一因素叠加，行业即将步入市场总量和国产市占率双升的红利期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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验，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

2021年上半年度，基金托管人在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021年上半年度，诺安基金管理有限公司在诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2021年上半年度，由诺安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	340,628,032.64	449,468,208.33
结算备付金		2,846,499.50	8,786,261.67
存出保证金		1,246,923.42	2,436,691.47
交易性金融资产	6.4.7.2	6,889,254,256.86	7,779,185,702.69
其中：股票投资		6,724,248,256.86	7,779,185,702.69
基金投资		-	-
债券投资		165,006,000.00	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	69,887,337.58
应收利息	6.4.7.5	3,462,178.66	99,620.50
应收股利		-	-
应收申购款		43,974,294.55	21,118,860.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,281,412,185.63	8,330,982,682.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		181,259,225.54	97,963,967.04
应付管理人报酬		8,440,840.12	10,710,543.89
应付托管费		1,406,806.68	1,785,090.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,946,787.53	3,391,081.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	626,935.41	413,862.90
负债合计		193,680,595.28	114,264,545.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,054,478,838.76	5,599,725,454.70

未分配利润	6.4.7.10	3,033,252,751.59	2,616,992,682.10
所有者权益合计		7,087,731,590.35	8,216,718,136.80
负债和所有者权益总计		7,281,412,185.63	8,330,982,682.68

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.7481元，基金份额总额4,054,478,838.76份。

6.2 利润表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		1,405,302,642.60	574,447,792.29
1.利息收入		1,681,594.89	1,038,400.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,381,961.11	1,038,400.65
债券利息收入		299,633.78	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		273,624,457.23	99,966,951.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	269,698,890.53	96,317,113.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-269,434.60	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	4,195,001.30	3,649,837.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,106,804,061.63	436,503,891.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,192,528.85	36,938,548.39
减：二、费用		65,869,082.34	29,876,283.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,932,314.77	19,065,257.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,322,052.48	3,177,542.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,466,392.19	7,505,987.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	148,322.90	127,495.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,339,433,560.26	544,571,509.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,339,433,560.26	544,571,509.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,599,725,454.70	2,616,992,682.10	8,216,718,136.80
二、本期经营活动产	-	1,339,433,560.26	1,339,433,560.26

生的基金净值变动数 (本期利润)			
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)	-1,545,246,615.94	-923,173,490.77	-2,468,420,106.71
其中: 1.基金申购款	2,646,515,734.69	1,250,085,757.29	3,896,601,491.98
2.基金赎回款	-4,191,762,350.63	-2,173,259,248.06	-6,365,021,598.69
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)	4,054,478,838.76	3,033,252,751.59	7,087,731,590.35
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,213,871,230.26	64,346,089.98	1,278,217,320.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	544,571,509.05	544,571,509.05
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)	1,219,948,483.88	600,336,404.26	1,820,284,888.14
其中: 1.基金申购款	5,901,172,174.70	1,926,834,834.76	7,828,007,009.46
2.基金赎回款	-4,681,223,690.82	-1,326,498,430.50	-6,007,722,121.32
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)	2,433,819,714.14	1,209,254,003.29	3,643,073,717.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

齐斌

田冲

薛有为

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、债券(包含国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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

投资行业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	340,628,032.64
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	340,628,032.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		5,614,042,847.19	6,724,248,256.86	1,110,205,409.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	164,999,969.40	165,006,000.00	6,030.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	164,999,969.40	165,006,000.00	6,030.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,779,042,816.59	6,889,254,256.86	1,110,211,440.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	58,684.74
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	1,152.90
应收债券利息	3,401,836.03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	504.99
合计	3,462,178.66

注：此处其他列示的是应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,946,787.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,946,787.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	498,920.67
应付证券出借违约金	-
预提费用	128,014.74
合计	626,935.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,599,725,454.70	5,599,725,454.70
本期申购	2,646,515,734.69	2,646,515,734.69
本期赎回（以“-”号填列）	-4,191,762,350.63	-4,191,762,350.63
本期末	4,054,478,838.76	4,054,478,838.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	-1,696,686,599.45	4,313,679,281.55	2,616,992,682.10
本期利润	232,629,498.63	1,106,804,061.63	1,339,433,560.26
本期基金份额交易产生的变动数	435,651,823.49	-1,358,825,314.26	-923,173,490.77
其中：基金申购款	-723,275,149.69	1,973,360,906.98	1,250,085,757.29
基金赎回款	1,158,926,973.18	-3,332,186,221.24	-2,173,259,248.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,028,405,277.33	4,061,658,028.92	3,033,252,751.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	1,340,899.48
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	19,678.37
其他	21,383.26
合计	1,381,961.11

注：此处其他列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,525,181,185.45
减：卖出股票成本总额	3,255,482,294.92
买卖股票差价收入	269,698,890.53

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	433,937,915.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	428,447,099.20
减：应收利息总额	5,760,250.85
买卖债券差价收入	-269,434.60

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,195,001.30
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	4,195,001.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	1,106,804,061.63
——股票投资	1,106,798,031.03
——债券投资	6,030.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,106,804,061.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	22,778,069.46
转换费收入	414,459.39
合计	23,192,528.85

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	7,466,392.19
银行间市场交易费用	-
合计	7,466,392.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,708.16
其他	600.00
账户维护费	27,000.00
合计	148,322.90

注：此处其他列示的是银行间市场清算所股份有限公司查询服务费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	49,932,314.77	19,065,257.15
其中：支付销售机构的客户维护费	20,494,690.43	6,790,192.30

注：本基金的管理费率为年费率1.5%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,322,052.48	3,177,542.87

注：本基金的托管费率为年费率0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	340,628,032.64	1,340,899.48	77,057,397.36	971,036.14

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688660	电气风电	2021-05-11	2021-11-19	新股锁定	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	新股锁定	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-

301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	新股锁定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股锁定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688517	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新股锁定	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川	2021-05	2021-1	新股	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

	畅银	-18	1-25	锁定						
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电	2021-06	2021-1	新股	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

	科技	-15	2-22	锁定						
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-1-25	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-1-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-0-1-06	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

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

本基金持有的流通受限股票“300948冠中生态”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积向全体股东每10股转增5股，其数量与金额也包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金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，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情

况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(2020年12月31日：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	340,628,032.64	-	-	-	-	340,628,032.64
结算备付金	2,846,499.50	-	-	-	-	2,846,499.50
存出保证金	1,246,923.42	-	-	-	-	1,246,923.42
交易性金融资产	165,006,000.00	-	-	-	6,724,248,256.86	6,889,254,256.86
应收利息	-	-	-	-	3,462,178.66	3,462,178.66
应收申购款	116,078.41	-	-	-	43,858,216.14	43,974,294.55
资产总计	509,843,533.97	-	-	-	6,771,568,651.66	7,281,412,185.63
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	181,259,225.54	181,259,225.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,440,840.12	8,440,840.12
应付托管费	-	-	-	-	1,406,806.68	1,406,806.68
应付交易费用	-	-	-	-	1,946,787.53	1,946,787.53
其他负债	-	-	-	-	626,935.41	626,935.41
负债总计	-	-	-	-	193,680,595.28	193,680,595.28
利率敏感度缺口	509,843,533.97	-	-	-	6,577,888,056.38	7,087,731,590.35
上年度末 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	449,468,208.33	-	-	-	-	449,468,208.33
结算备付金	8,786,261.67	-	-	-	-	8,786,261.67
存出保证金	2,436,691.47	-	-	-	-	2,436,691.47
交易性金融资产	-	-	-	-	7,779,185,702.69	7,779,185,702.69
应收证券清算款	-	-	-	-	69,887,337.58	69,887,337.58
应收利息	-	-	-	-	99,620.50	99,620.50
应收申购款	10,878.00	-	-	-	21,107,982.44	21,118,860.44
资产总计	460,702,039.47	-	-	-	7,870,280,643.21	8,330,982,682.68
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	97,963,967.04	97,963,967.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,710,543.89	10,710,543.89
应付托管费	-	-	-	-	1,785,090.66	1,785,090.66

应付交易费用	-	-	-	-	3,391,081.39	3,391,081.39
其他负债	-	-	-	-	413,862.90	413,862.90
负债总计	-	-	-	-	114,264,545.88	114,264,545.88
利率敏感度缺口	460,702,039.47	-	-	-	7,756,016,097.33	8,216,718,136.80

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为2.33%(2020年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)

交易性金融资产 — 股票投资	6,724,248,256.86	94.87	7,779,185,702.69	94.68
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
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	6,724,248,256.86	94.87	7,779,185,702.69	94.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化		
	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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	322,375,737.36	504,028,230.74
	2.业绩比较基准下降5%	-322,375,737.36	-504,028,230.74

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证全债指数×40%。

6.4.14 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6月30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6,717,039,516.76元，属于第二层次的余额为172,214,740.10

元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次7,644,513,172.56元，第二层次134,672,530.13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6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,724,248,256.86	92.35
	其中：股票	6,724,248,256.86	92.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	165,006,000.00	2.27
	其中：债券	165,006,000.00	2.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	343,474,532.14	4.72
8	其他各项资产	48,683,396.63	0.67
9	合计	7,281,412,185.63	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	207,418.70	0.00
B	采矿业	87,263.74	0.00
C	制造业	6,478,256,468.01	91.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,329,273.97	0.08
E	建筑业	47,544.03	0.00
F	批发和零售业	698,914.14	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	48,585.39	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,072,112.98	3.34
J	金融业	355,400.32	0.01
K	房地产业	100,793.04	0.00
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,149,860.11	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	758,682.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,691.73	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	35,783.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,724,248,256.86	94.87

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例(%)
1	300661	圣邦股份	2,974,821	751,826,511.33	10.61
2	603986	兆易创新	3,848,330	723,101,207.00	10.20
3	300782	卓胜微	1,317,819	708,327,712.50	9.99
4	002371	北方华创	2,528,003	701,217,472.14	9.89
5	603501	韦尔股份	2,089,585	672,846,370.00	9.49
6	688981	中芯国际	10,851,241	670,823,718.62	9.46
7	688012	中微公司	4,012,960	665,830,323.20	9.39
8	688126	沪硅产业	19,623,458	572,612,504.44	8.08
9	600703	三安光电	13,894,759	445,327,025.95	6.28
10	688339	亿华通	960,440	271,516,388.00	3.83
11	600584	长电科技	7,189,541	270,901,904.88	3.82
12	688521	芯原股份	3,022,507	235,664,870.79	3.32
13	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.07
14	688538	和辉光电	375,156	1,429,344.36	0.02
15	688819	天能股份	28,382	1,262,715.18	0.02
16	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.01
17	300919	中伟股份	6,093	993,159.00	0.01
18	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.01
19	688680	海优新材	2,795	718,315.00	0.01
20	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.01
21	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.01
22	688626	翔宇医疗	3,652	441,307.68	0.01
23	300894	火星人	6,279	426,972.00	0.01
24	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
25	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.01
26	688317	之江生物	5,740	372,813.00	0.01
27	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.01
28	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
29	688055	龙腾光电	45,228	355,944.36	0.01
30	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00

31	688558	国盛智科	8,488	309,812.00	0.00
32	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.00
33	688630	芯碁微装	3,397	261,840.76	0.00
34	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
35	605111	新洁能	1,386	249,854.22	0.00
36	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
37	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.00
38	688079	美迪凯	10,622	208,509.86	0.00
39	300941	创识科技	3,989	204,452.06	0.00
40	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.00
41	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
42	300968	格林精密	11,620	179,261.74	0.00
43	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.00
44	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.00
45	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.00
46	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.00
47	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.00
48	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00
49	688619	罗普特	5,856	161,040.00	0.00
50	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
51	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.00
52	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
53	300932	三友联众	4,918	157,897.22	0.00
54	300925	法本信息	5,997	157,661.13	0.00
55	688687	凯因科技	5,354	155,266.00	0.00
56	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.00
57	688076	诺泰生物	2,189	149,311.69	0.00
58	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00
59	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.00
60	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.00
61	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.00

62	688069	德林海	2,253	134,459.04	0.00
63	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.00
64	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.00
65	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
66	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.00
67	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.00
68	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
69	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.00
70	688667	菱电电控	1,191	131,021.91	0.00
71	688219	会通股份	7,336	128,526.72	0.00
72	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.00
73	688569	铁科轨道	6,841	127,653.06	0.00
74	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.00
75	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.00
76	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.00
77	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
78	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.00
79	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.00
80	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.00
81	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.00
82	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.00
83	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.00
84	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.00
85	605376	博迁新材	1,421	104,983.48	0.00
86	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.00
87	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.00
88	688109	品茗股份	1,301	101,009.64	0.00
89	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.00
90	300917	特发服务	3,644	100,793.04	0.00
91	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.00
92	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.00

93	300922	天秦装备	2,863	99,718.29	0.00
94	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.00
95	688668	鼎通科技	3,037	99,461.75	0.00
96	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.00
97	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
98	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.00
99	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.00
100	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.00
101	601568	北元集团	11,007	94,219.92	0.00
102	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.00
103	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.00
104	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.00
105	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.00
106	300948	冠中生态	3,229	92,867.63	0.00
107	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.00
108	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.00
109	003022	联泓新科	2,995	91,946.50	0.00
110	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.00
111	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.00
112	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.00
113	688669	聚石化学	2,681	87,909.99	0.00
114	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.00
115	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.00
116	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.00
117	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
118	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.00
119	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.00
120	300971	博亚精工	2,445	84,503.05	0.00
121	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.00
122	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00
123	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00

124	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.00
125	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.00
126	300926	博俊科技	3,584	80,854.80	0.00
127	605358	立昂微	693	80,096.94	0.00
128	300930	屹通新材	3,220	80,013.78	0.00
129	605117	德业股份	627	80,005.20	0.00
130	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
131	688577	浙海德曼	1,503	77,675.04	0.00
132	688590	新致软件	4,171	77,163.50	0.00
133	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.00
134	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
135	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
136	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
137	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.00
138	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
139	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.00
140	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.00
141	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
142	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
143	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.00
144	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.00
145	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.00
146	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
147	300886	华业香料	1,903	61,714.29	0.00
148	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.00
149	688557	兰剑智能	1,812	60,973.80	0.00
150	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
151	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
152	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.00
153	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
154	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00

155	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
156	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
157	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.00
158	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
159	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
160	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
161	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
162	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
163	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.00
164	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
165	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
166	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
167	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
168	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
169	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
170	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
171	601187	厦门银行	5,129	48,622.92	0.00
172	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
173	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
174	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
175	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
176	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
177	003026	中晶科技	460	43,290.60	0.00
178	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
179	003021	兆威机电	680	41,534.40	0.00
180	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.00
181	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
182	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.00
183	300861	美畅股份	454	38,276.74	0.00
184	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.00
185	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00

186	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
187	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
188	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
189	003009	中天火箭	623	36,183.84	0.00
190	300860	锋尚文化	614	35,783.92	0.00
191	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
192	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
193	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
194	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
195	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
196	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
197	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
198	605338	巴比食品	1,012	32,717.96	0.00
199	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
200	300872	天阳科技	871	31,617.30	0.00
201	300870	欧陆通	478	29,884.56	0.00
202	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.00
203	605077	华康股份	617	28,147.54	0.00
204	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
205	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
206	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
207	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
208	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
209	601686	友发集团	2,374	26,493.84	0.00
210	605099	共创草坪	624	26,445.12	0.00
211	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
212	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
213	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.00
214	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
215	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
216	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00

217	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.00
218	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
219	605186	健麾信息	626	21,459.28	0.00
220	300877	金春股份	569	20,922.13	0.00
221	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
222	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
223	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
224	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
225	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
226	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
227	003020	立方制药	374	19,148.80	0.00
228	003006	百亚股份	804	19,054.80	0.00
229	605336	帅丰电器	701	18,856.90	0.00
230	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
231	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
232	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
233	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
234	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
235	300868	杰美特	593	18,151.73	0.00
236	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
237	300864	南大环境	315	17,328.15	0.00
238	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
239	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
240	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
241	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
242	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.00
243	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
244	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
245	003013	地铁设计	724	16,507.20	0.00
246	003019	宸展光电	601	16,263.06	0.00
247	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00

248	605377	华旺科技	1,050	16,212.00	0.00
249	003005	竞业达	412	16,125.68	0.00
250	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
251	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
252	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
253	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.00
254	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
255	003010	若羽臣	562	15,269.54	0.00
256	003015	日久光电	1,128	14,551.20	0.00
257	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
258	605177	东亚药业	439	14,254.33	0.00
259	003027	同兴环保	523	14,251.75	0.00
260	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
261	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
262	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
263	300907	康平科技	473	13,915.66	0.00
264	605169	洪通燃气	951	13,913.13	0.00
265	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
266	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
267	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
268	605500	森林包装	762	13,464.54	0.00
269	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
270	605151	西上海	722	13,270.36	0.00
271	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
272	605183	确成股份	741	12,967.50	0.00
273	003025	思进智能	427	12,959.45	0.00
274	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.00
275	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
276	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
277	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
278	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00

279	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
280	003018	金富科技	1,027	11,718.07	0.00
281	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
282	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
283	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
284	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
285	605007	五洲特纸	598	11,260.34	0.00
286	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
287	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
288	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
289	605258	协和电子	340	10,931.00	0.00
290	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
291	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
292	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
293	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
294	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
295	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
296	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
297	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
298	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
299	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
300	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
301	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
302	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
303	003023	彩虹集团	296	8,968.80	0.00
304	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
305	003004	声迅股份	306	8,613.90	0.00
306	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
307	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
308	605155	西大门	350	7,696.50	0.00
309	300991	创益通	254	6,733.54	0.00

310	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	219,991,998.42	2.68
2	603986	兆易创新	154,949,348.50	1.89
3	300223	北京君正	152,712,513.03	1.86
4	688012	中微公司	119,985,008.80	1.46
5	002371	北方华创	113,013,511.38	1.38
6	300059	东方财富	79,983,540.44	0.97
7	688981	中芯国际	29,999,945.28	0.37
8	300782	卓胜微	29,929,324.00	0.36
9	002532	天山铝业	19,998,631.00	0.24
10	603501	韦尔股份	19,973,689.23	0.24
11	300896	爱美客	19,904,440.14	0.24
12	600733	北汽蓝谷	14,997,281.97	0.18
13	688521	芯原股份	14,262,005.80	0.17
14	688126	沪硅产业	9,999,900.75	0.12
15	601600	中国铝业	9,999,792.00	0.12
16	000960	锡业股份	9,999,765.17	0.12
17	000933	神火股份	9,999,600.00	0.12
18	000807	云铝股份	9,999,282.26	0.12
19	300672	国科微	9,998,567.99	0.12
20	000625	长安汽车	9,997,975.00	0.12

注：本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	561,730,168.50	6.84
2	300782	卓胜微	464,720,447.08	5.66

3	600584	长电科技	452,924,048.18	5.51
4	603501	韦尔股份	424,833,081.14	5.17
5	300223	北京君正	410,906,580.77	5.00
6	605111	新洁能	295,442,959.46	3.60
7	603986	兆易创新	199,956,037.30	2.43
8	600703	三安光电	162,263,420.24	1.97
9	688981	中芯国际	130,115,553.74	1.58
10	688012	中微公司	120,003,397.99	1.46
11	300059	东方财富	83,611,852.71	1.02
12	688339	亿华通	59,999,693.90	0.73
13	300896	爱美客	21,843,285.64	0.27
14	600733	北汽蓝谷	16,424,272.00	0.20
15	002532	天山铝业	16,213,187.00	0.20
16	000625	长安汽车	10,844,199.00	0.13
17	300014	亿纬锂能	10,450,851.49	0.13
18	688126	沪硅产业	9,999,972.14	0.12
19	601127	小康股份	9,592,856.31	0.12
20	000807	云铝股份	9,323,823.72	0.11

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,093,746,818.06
卖出股票收入（成交）总额	3,525,181,185.45

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	165,006,000.00	2.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,006,000.00	2.33

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019640	20国债10	1,650,060	165,006,000.00	2.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体,本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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,246,923.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,462,178.66
5	应收申购款	43,974,294.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,683,396.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
319,280	12,698.82	372,548,820.25	9.19%	3,681,930,018.51	90.81%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,135,120.24	0.0527%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年05月10日)基金份额总额	270,829,069.66
本报告期期初基金份额总额	5,599,725,454.70
本报告期基金总申购份额	2,646,515,734.69
减：本报告期基金总赎回份额	4,191,762,350.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,054,478,838.76

注：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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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、于东升先生担任公司副总经理、总经理齐斌先生代任公司督察长；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，本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	2,389,496,612.89	51.89%	1,699,648.82	48.61%	-
中泰证券	1	1,103,998,418.72	23.97%	1,006,074.80	28.78%	-
国金证券	1	565,976,705.72	12.29%	402,579.76	11.51%	-
天风证券	1	545,396,563.61	11.84%	387,952.20	11.10%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加2个证券公司2个交易单元：天风证券股份有限公司（1个交易单元），华金证券股份有限公司（1个交易单元）

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

- (1) 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,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	631,721,292.10	61.83%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	389,903,441.10	38.17%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下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》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-04
2	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-05
3	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-16
4	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-22
5	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021-01-22
6	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-02-08

		》、《证券日报》	
7	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	2021-02-08
8	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》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-03-12
9	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加代销机构并在代销机构开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》	2021-03-23
10	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》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-03-29
11	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》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-03-31
12	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》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-03-31
13	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站	2021-03-31
14	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》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-04-01

		》	
15	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-04-02
16	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2021-04-21
17	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-04-21
18	诺安和鑫灵活配置混合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	2021-04-21
19	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-04-22
20	诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金2021年第1季度报告	基金管理人网站	2021-04-22
21	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》	2021-04-28
22	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》	2021-05-29
23	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-11
24	诺安基金管理有限公司关于诺安和鑫混合增加中国银河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》	2021-06-24
25	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变	《上海证券报》	2021-06-26

	更的公告		
26	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-30
27	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-30

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	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基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，敬请投资者留意。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安和鑫保本混合型证券投资基金公开募集的文件。

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

③《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

- ④《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- ⑤《诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。
- ⑥基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑦诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告正文。
- ⑧报告期内诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日