

# 诺安成长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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	51
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	52
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 .....	60
§12 备查文件目录 .....	60
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	诺安成长混合型证券投资基金
基金简称	诺安成长混合
基金主代码	320007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年03月10日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,188,365,107.78份
基金合同存续期	不定期

注：自2015年8月6日起，原“诺安成长股票型证券投资基金”变更为“诺安成长混合型证券投资基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金主要投资于具有良好成长性的企业,同时兼顾企业成长能力的可持续性,并对其投资价值做出定性及定量分析,力图在享受到企业成长溢价的同时获得长期稳定的回报。</p>
投资策略	<p>本基金具体的投资策略由资产配置,股票投资,债券投资和权证投资四部分构成。</p> <p>(1)在资产配置方面,本基金采用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方式进行。</p> <p>(2)在股票投资方面,本基金投资于成长性企业的比例不小于本基金所持股票资产的80%。</p> <p>(3)在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略、收益率曲线模拟策略、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于债券市场平均水平的投资回报。</p> <p>(4)在权证投资方面,本基金主要运用价值发现和价差策略。作为辅助性投资工具,本基金结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%</p>

风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。
--------	--

注：自2020年8月12日起，本基金业绩比较基准由“80%×标普中国A股综合指数+20%×上证国债指数”变更为“中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%”。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	0755-83026677	(010) 66105798
注册地址	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	秦维舟	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	2,514,261,376.33
本期利润	6,780,925,253.92
加权平均基金份额本期利润	0.4029
本期加权平均净值利润率	23.33%
本期基金份额净值增长率	23.60%
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	-13,009,655,214.03
期末可供分配基金份额利润	-0.9864
期末基金资产净值	28,177,266,860.10
期末基金份额净值	2.137
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	220.08%

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	21.28%	2.69%	-0.85%	0.54%	22.13%	2.15%
过去三个月	39.49%	2.21%	3.68%	0.62%	35.81%	1.59%
过去六个月	23.60%	2.22%	2.05%	0.85%	21.55%	1.37%
过去一年	23.53%	2.40%	7.86%	0.75%	15.67%	1.65%

过去三年	170.16%	2.49%	21.76%	1.00%	148.40%	1.49%
自基金合同生效起至今	220.08%	1.90%	123.01%	1.18%	97.07%	0.72%

注：自2015年11月2日起，本基金的业绩比较基准由原来的“中信标普A股综合指数以及上证国债指数的复合指数即： $80\% \times \text{中综指} + 20\% \times \text{上证国债指数}$ ”，更名为“标普中国A股综合指数以及上证国债指数的复合指数即： $80\% \times \text{标普中国A股综合指数} + 20\% \times \text{上证国债指数}$ ”；自2020年8月12日起，本基金业绩比较基准由“ $80\% \times \text{标普中国A股综合指数} + 20\% \times \text{上证国债指数}$ ”变更为“ $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 30\%$ ”。

### 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

诺安成长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  
(2009年03月10日-2021年06月30日)



注：①本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。  
②自2020年8月12日起，本基金业绩比较基准由“ $80\% \times \text{标普中国A股综合指数} + 20\% \times \text{上证国债指数}$ ”变更为“ $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 30\%$ ”。

## §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	2019年02	-	6年	博士，具有基金从业资格

	金经理	月20日			。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，诺安成长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《诺安成长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，担忧本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，诺安成长混合基金份额净值为2.137元；本报告期内，基金份额净值增长率为23.60%，同期业绩比较基准收益率为2.05%。

#### 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

本基金合同约定，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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的50%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对诺安成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，诺安成长混合型证券投资基金的管理人--诺安基金管理有限公司在诺安成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安成长混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安成长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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,873,025,344.88	2,700,942,007.05
结算备付金		16,578,301.07	38,983,966.54
存出保证金		4,212,543.52	4,664,761.44
交易性金融资产	6.4.7.2	26,544,666,183.32	30,339,960,294.00
其中：股票投资		26,544,666,183.32	30,339,960,294.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		533,915,600.50	312,757,611.65
应收利息	6.4.7.5	139,488.16	287,874.32
应收股利		-	-
应收申购款		401,329,383.16	110,275,637.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,373,866,844.61	33,507,872,152.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 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	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		1,139,700,829.50	670,550,999.12
应付管理人报酬		36,173,831.00	41,730,044.39
应付托管费		6,028,971.80	6,955,007.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,341,358.76	10,252,677.12
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	4,354,993.45	2,738,405.23
负债合计		1,196,599,984.51	732,227,133.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	13,188,365,107.78	18,956,430,702.08

未分配利润	6.4.7.10	14,988,901,752.32	13,819,214,317.18
所有者权益合计		28,177,266,860.10	32,775,645,019.26
负债和所有者权益总计		29,373,866,844.61	33,507,872,152.51

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值2.137元，基金份额总额13,188,365,107.78份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安成长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202 0年06月30日
一、收入		7,075,588,245.64	2,954,631,381.67
1.利息收入		4,828,144.63	3,800,476.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,386,315.04	3,800,476.74
债券利息收入		441,829.59	-
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）		2,729,517,165.86	529,193,997.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,705,808,032.66	513,881,679.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-213,728.80	-
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	23,922,862.00	15,312,318.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,266,663,877.59	2,357,782,980.42
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	74,579,057.56	63,853,926.89
<b>减：二、费用</b>		294,662,991.72	138,664,014.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	216,274,158.18	91,301,378.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,045,692.96	15,216,896.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	42,222,868.56	32,050,579.44
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	120,272.02	95,159.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,780,925,253.92	2,815,967,367.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,780,925,253.92	2,815,967,367.35

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安成长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)	18,956,430,702.08	13,819,214,317.18	32,775,645,019.26
二、本期经营活动	-	6,780,925,253.92	6,780,925,253.92



产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)	-5,768,065,594.30	-5,611,237,818.78	-11,379,303,413.08
其中：1.基金申购款	20,173,494,673.23	15,543,851,758.18	35,717,346,431.41
2.基金赎回款	-25,941,560,267.53	-21,155,089,576.96	-47,096,649,844.49
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)	13,188,365,107.78	14,988,901,752.32	28,177,266,860.10
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)	5,387,731,829.48	1,309,086,489.16	6,696,818,318.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,815,967,367.35	2,815,967,367.35
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)	3,929,785,458.82	2,676,714,315.69	6,606,499,774.51
其中：1.基金申购款	25,479,417,289.22	13,553,434,120.77	39,032,851,409.99
2.基金赎回款	-21,549,631,830.40	-10,876,719,805.08	-32,426,351,635.48

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）	9,317,517,288.30	6,801,768,172.20	16,119,285,460.50

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

诺安成长混合型证券投资基金(原名为“诺安成长股票型证券投资基金”，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2008〕1283号《关于核准诺安成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,167,719,577.94元。经向中国证监会备案，《诺安成长股票型证券投资基金基金合同》于2009年3月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,167,838,082.92份基金份额，其中认购资金利息折合118,504.98份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，诺安成长股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为诺安成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围界定为股票、债券、权证以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的，具有良好流动性的A股，主要投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票；债券投资主要包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债；权证投资等新的金融产品将在法律法规允许的范围内进行投资；现金资产主要投资于各类银行存款。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为60-95%，其中投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票不低于股票投资的80%；债券投资、现金等固定收益金融工具占基金资产的比例为5-40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净

值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。于2020年8月12日前，本基金的业绩比较基准为：标普中国A股综合指数×80%+上证国债指数×20%；自2020年8月12日起，本基金的业绩比较基准变更为：中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%。

#### 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》、《诺安成长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日期间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	1,873,025,344.88
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	1,873,025,344.88

**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	20,857,334,886.28	26,544,666,183.32	5,687,331,297.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,857,334,886.28	26,544,666,183.32	5,687,331,297.04

**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	131,067.85
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	6,714.27
应收债券利息	-
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	1,706.04
合计	139,488.16

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	10,341,358.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,341,358.76

#### 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	4,235,978.71
应付证券出借违约金	-
预提费用	119,014.74
合计	4,354,993.45

#### 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	18,956,430,702.08	18,956,430,702.08
本期申购	20,173,494,673.23	20,173,494,673.23
本期赎回（以“-”号填列）	-25,941,560,267.53	-25,941,560,267.53
本期末	13,188,365,107.78	13,188,365,107.78

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	-21,842,837,218.99	35,662,051,536.17	13,819,214,317.18
本期利润	2,514,261,376.33	4,266,663,877.59	6,780,925,253.92
本期基金份额交易产生的变动数	6,318,920,628.63	-11,930,158,447.41	-5,611,237,818.78
其中：基金申购款	-22,036,423,090.69	37,580,274,848.87	15,543,851,758.18
基金赎回款	28,355,343,719.32	-49,510,433,296.28	-21,155,089,576.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,009,655,214.03	27,998,556,966.35	14,988,901,752.32

#### 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	4,182,698.43
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	149,873.18
其他	53,743.43
合计	4,386,315.04

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	19,041,152,394.13
减：卖出股票成本总额	16,335,344,361.47
买卖股票差价收入	2,705,808,032.66

**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	1,138,769,812.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,121,655,263.10
减：应收利息总额	17,328,278.64
买卖债券差价收入	-213,728.80

**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	23,922,862.00
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	23,922,862.00

**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	4,266,663,877.59
——股票投资	4,266,663,877.59
——债券投资	-
——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	4,266,663,877.59

**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	73,973,897.63
转换费收入	605,159.93
合计	74,579,057.56

**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	42,222,868.56
银行间市场交易费用	-
合计	42,222,868.56

**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	1,257.28
合计	120,272.02

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，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
中国工商银行股份有限公司	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	216,274,158.18	91,301,378.49

其中：支付销售机构的客户维护费	80,944,692.08	31,137,807.21
-----------------	---------------	---------------

注：本基金的管理费率为年费率1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	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	36,045,692.96	15,216,896.43

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	25,487,680.54	25,487,680.54

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	25,487,680.54	25,487,680.54
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	0.27%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

#### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	1,873,025,344.88	4,182,698.43	805,318,716.58	3,503,647.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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	-

688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股锁定	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新股锁定	133.73	780.24	1,073	143,492.29	837,197.52	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股锁定	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
301006	迈拓股份	2021-05-31	2021-12-07	新股锁定	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
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	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股锁定	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
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	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股锁定	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
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	-
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	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
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	-
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	-
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	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
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	-
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	2021-06	2021-1	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

	医药	-22	2-30							
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	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	2021-11-17	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	2021-06	2022-0	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

	平民	-23	1-05							
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	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	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，本基金无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次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，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，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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同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、存出保证金和应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,873,025,344.88	-	-	-	-	1,873,025,344.88
结算备付金	16,578,301.07	-	-	-	-	16,578,301.07
存出保证金	4,212,543.52	-	-	-	-	4,212,543.52
交易性金融资产	-	-	-	-	26,544,666,183.32	26,544,666,183.32
应收证券清算款	-	-	-	-	533,915,600.50	533,915,600.50
应收利息	-	-	-	-	139,488.16	139,488.16
应收申购款	545,375.67	-	-	-	400,784,007.49	401,329,383.16
资产总计	1,894,361,565.14	-	-	-	27,479,505,279.47	29,373,866,844.61
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,139,700,829.50	1,139,700,829.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	36,173,831.00	36,173,831.00
应付托管费	-	-	-	-	6,028,971.80	6,028,971.80
应付交易费用	-	-	-	-	10,341,358.76	10,341,358.76
其他负债	-	-	-	-	4,354,993.45	4,354,993.45
负债总计	-	-	-	-	1,196,599,984.51	1,196,599,984.51
利率敏感度缺口	1,894,361,565.14	-	-	-	26,282,905,294.96	28,177,266,860.10
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	2,700,942,007.05	-	-	-	-	2,700,942,007.05
结算备付金	38,983,966.54	-	-	-	-	38,983,966.54
存出保证金	4,664,761.44	-	-	-	-	4,664,761.44
交易性金融资产	-	-	-	-	30,339,960,294.00	30,339,960,294.00
应收证券清算款	-	-	-	-	312,757,611.65	312,757,611.65
应收利息	-	-	-	-	287,874.32	287,874.32
应收申购款	2,136,327.70	-	-	-	108,139,309.81	110,275,637.51
资产总计	2,746,727,062.73	-	-	-	30,761,145,089.78	33,507,872,152.51
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	670,550,999.12	670,550,999.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	41,730,044.39	41,730,044.39
应付托管费	-	-	-	-	6,955,007.39	6,955,007.39
应付交易费用	-	-	-	-	10,252,677.12	10,252,677.12
其他负债	-	-	-	-	2,738,405.23	2,738,405.23
负债总计	-	-	-	-	732,227,133.25	732,227,133.25
利率敏感度缺口	2,746,727,062.73	-	-	-	30,028,917,956.53	32,775,645,019.26

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，本基金未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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：股票投资占基金资产的比例为60-95%，其中投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票不低于股票投资的80%；债券投资、现金等固定收益金融工具占基金资产的比例为5-40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。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	26,544,666,183.32	94.21	30,339,960,294.00	92.57
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	26,544,666,183.32	94.21	30,339,960,294.00	92.57

#### 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%	1,480,380,297.68	2,104,073,579.30
	2.业绩比较基准下降5%	-1,480,380,297.68	-2,104,073,579.30

注：本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%。

#### 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26,535,723,586.42元，属于第二层次的余额为8,942,596.90元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次29,814,524,509.63元，第二层次525,435,784.37元，无第三层次余额)。

**(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	26,544,666,183.32	90.37

	其中：股票	26,544,666,183.32	90.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,889,603,645.95	6.43
8	其他各项资产	939,597,015.34	3.20
9	合计	29,373,866,844.61	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	26,019,483,119.44	92.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,329,259.34	0.02
E	建筑业	207,169.38	0.00
F	批发和零售业	698,914.14	0.00
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	269,480,069.56	0.96
J	金融业	1,889,886.82	0.01
K	房地产业	100,820.70	0.00
L	租赁和商务服务业	244,404,258.16	0.87
M	科学研究和技术服务业	1,149,860.11	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,509,082.19	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	26,544,666,183.32	94.21

### 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	11,647,427	2,943,654,225.71	10.45
2	603986	兆易创新	15,325,203	2,879,605,643.70	10.22
3	603501	韦尔股份	8,735,796	2,812,926,312.00	9.98
4	300782	卓胜微	5,197,092	2,793,436,950.00	9.91
5	002371	北方华创	9,758,719	2,706,873,476.22	9.61
6	688012	中微公司	16,026,129	2,659,055,323.68	9.44
7	688981	中芯国际	40,978,535	2,533,293,033.70	8.99
8	600703	三安光电	78,249,604	2,507,899,808.20	8.90
9	688126	沪硅产业	41,723,496	1,217,491,613.28	4.32
10	600584	长电科技	24,030,005	905,450,588.40	3.21
11	300223	北京君正	8,740,144	882,055,332.48	3.13
12	300655	晶瑞电材	16,980,243	619,609,067.07	2.20
13	688521	芯原股份	3,412,078	266,039,721.66	0.94
14	300280	紫天科技	6,692,380	244,338,793.80	0.87
15	300457	赢合科技	11,335,070	225,114,490.20	0.80
16	688339	亿华通	649,704	183,671,320.80	0.65
17	002324	普利特	10,087,532	118,024,124.40	0.42
18	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.02
19	601995	中金公司	24,951	1,534,486.50	0.01
20	688538	和辉光电	375,156	1,429,344.36	0.01
21	688819	天能股份	28,382	1,262,715.18	0.00



22	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.00
23	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.00
24	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.00
25	300919	中伟股份	6,093	993,159.00	0.00
26	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.00
27	688408	中信博	4,450	893,560.00	0.00
28	688696	极米科技	1,073	837,197.52	0.00
29	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.00
30	688680	海优新材	2,795	718,315.00	0.00
31	688057	金达莱	21,850	684,342.00	0.00
32	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.00
33	300896	爱美客	852	672,125.76	0.00
34	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.00
35	688699	明微电子	1,869	533,263.08	0.00
36	300910	瑞丰新材	4,736	495,148.80	0.00
37	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.00
38	688626	翔宇医疗	3,652	441,307.68	0.00
39	300894	火星人	6,279	426,972.00	0.00
40	688508	芯朋微	3,729	412,576.56	0.00
41	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.00
42	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.00
43	688317	之江生物	5,740	372,813.00	0.00
44	688578	艾力斯	10,734	353,899.98	0.00
45	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.00
46	300900	广联航空	8,782	328,271.16	0.00
47	688135	利扬芯片	5,658	318,998.04	0.00
48	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.00
49	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.00
50	300953	震裕科技	2,394	258,642.30	0.00
51	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.00
52	688566	吉贝尔	9,882	252,386.28	0.00

53	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
54	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
55	688488	艾迪药业	9,934	233,051.64	0.00
56	688665	四方光电	1,687	229,685.05	0.00
57	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.00
58	688079	美迪凯	10,622	208,509.86	0.00
59	300941	创识科技	3,989	204,452.06	0.00
60	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.00
61	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.00
62	688386	泛亚微透	3,217	188,998.75	0.00
63	688136	科兴制药	4,981	184,695.48	0.00
64	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
65	300968	格林精密	11,620	179,261.74	0.00
66	688609	九联科技	10,372	179,228.16	0.00
67	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.00
68	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.00
69	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.00
70	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.00
71	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.00
72	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.00
73	300909	汇创达	3,858	166,279.80	0.00
74	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00
75	688619	罗普特	5,856	161,040.00	0.00
76	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
77	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
78	300932	三友联众	4,918	157,897.22	0.00
79	300925	法本信息	5,998	157,687.42	0.00
80	688510	航亚科技	5,991	157,563.30	0.00
81	688529	豪森股份	6,125	156,738.75	0.00
82	688687	凯因科技	5,354	155,266.00	0.00
83	300903	科翔股份	4,775	153,086.50	0.00

84	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.00
85	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00
86	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.00
87	300907	康平科技	4,724	138,980.08	0.00
88	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.00
89	300940	南极光	3,068	136,458.26	0.00
90	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.00
91	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.00
92	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
93	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.00
94	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.00
95	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
96	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.00
97	688667	菱电电控	1,191	131,021.91	0.00
98	300902	国安达	5,510	129,815.60	0.00
99	688219	会通股份	7,336	128,526.72	0.00
100	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.00
101	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.00
102	688077	大地熊	2,829	126,541.17	0.00
103	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.00
104	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.00
105	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.00
106	688160	步科股份	2,771	116,354.29	0.00
107	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
108	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.00
109	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.00
110	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.00
111	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.00
112	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.00
113	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.00
114	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.00

115	605376	博迁新材	1,421	104,983.48	0.00
116	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.00
117	688555	泽达易盛	3,004	103,157.36	0.00
118	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.00
119	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.00
120	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.00
121	300917	特发服务	3,645	100,820.70	0.00
122	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.00
123	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.00
124	300922	天秦装备	2,863	99,718.29	0.00
125	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.00
126	688668	鼎通科技	3,037	99,461.75	0.00
127	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
128	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.00
129	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.00
130	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.00
131	688129	东来技术	5,033	94,368.75	0.00
132	601568	北元集团	11,007	94,219.92	0.00
133	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.00
134	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.00
135	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.00
136	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.00
137	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
138	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.00
139	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.00
140	300948	冠中生态	3,230	92,896.54	0.00
141	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.00
142	003022	联泓新科	2,995	91,946.50	0.00
143	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.00
144	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.00
145	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.00

146	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.00
147	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.00
148	688669	聚石化学	2,681	87,909.99	0.00
149	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.00
150	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.00
151	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.00
152	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
153	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.00
154	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.00
155	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.00
156	300971	博亚精工	2,445	84,503.05	0.00
157	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.00
158	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00
159	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
160	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.00
161	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.00
162	300926	博俊科技	3,584	80,854.80	0.00
163	605358	立昂微	693	80,096.94	0.00
164	300930	屹通新材	3,220	80,013.78	0.00
165	605117	德业股份	627	80,005.20	0.00
166	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
167	688590	新致软件	4,171	77,163.50	0.00
168	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.00
169	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
170	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
171	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.00
172	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
173	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.00
174	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.00
175	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
176	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.00

177	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.00
178	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
179	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.00
180	688557	兰剑智能	1,812	60,973.80	0.00
181	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.00
182	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
183	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
184	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.00
185	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
186	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
187	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00
188	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
189	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
190	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.00
191	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
192	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
193	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
194	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.00
195	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
196	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
197	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
198	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
199	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
200	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
201	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
202	601187	厦门银行	5,129	48,622.92	0.00
203	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
204	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
205	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
206	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
207	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00

208	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
209	003026	中晶科技	460	43,290.60	0.00
210	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
211	003021	兆威机电	680	41,534.40	0.00
212	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.00
213	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
214	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.00
215	300861	美畅股份	454	38,276.74	0.00
216	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.00
217	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
218	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
219	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
220	003009	中天火箭	623	36,183.84	0.00
221	300860	锋尚文化	614	35,783.92	0.00
222	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
223	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
224	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
225	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
226	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
227	605338	巴比食品	1,012	32,717.96	0.00
228	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
229	300872	天阳科技	871	31,617.30	0.00
230	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
231	300870	欧陆通	478	29,884.56	0.00
232	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.00
233	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00
234	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
235	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
236	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
237	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
238	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00

239	601686	友发集团	2,374	26,493.84	0.00
240	605099	共创草坪	624	26,445.12	0.00
241	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
242	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.00
243	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
244	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
245	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
246	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.00
247	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
248	605186	健麾信息	626	21,459.28	0.00
249	300877	金春股份	569	20,922.13	0.00
250	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
251	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
252	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
253	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
254	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
255	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
256	003020	立方制药	374	19,148.80	0.00
257	003006	百亚股份	804	19,054.80	0.00
258	605336	帅丰电器	701	18,856.90	0.00
259	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
260	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
261	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
262	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
263	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
264	300868	杰美特	593	18,151.73	0.00
265	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
266	300864	南大环境	316	17,383.16	0.00
267	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
268	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
269	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00



270	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
271	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.00
272	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
273	003013	地铁设计	724	16,507.20	0.00
274	003019	宸展光电	601	16,263.06	0.00
275	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
276	605377	华旺科技	1,050	16,212.00	0.00
277	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
278	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
279	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
280	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.00
281	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
282	003010	若羽臣	562	15,269.54	0.00
283	003015	日久光电	1,128	14,551.20	0.00
284	605177	东亚药业	439	14,254.33	0.00
285	003027	同兴环保	523	14,251.75	0.00
286	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
287	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
288	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
289	605169	洪通燃气	950	13,898.50	0.00
290	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
291	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
292	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
293	605500	森林包装	762	13,464.54	0.00
294	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
295	605151	西上海	722	13,270.36	0.00
296	605183	确成股份	741	12,967.50	0.00
297	003025	思进智能	427	12,959.45	0.00
298	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.00
299	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
300	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00

301	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
302	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
303	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
304	003018	金富科技	1,027	11,718.07	0.00
305	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
306	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
307	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
308	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
309	605007	五洲特纸	598	11,260.34	0.00
310	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
311	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
312	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
313	605258	协和电子	340	10,931.00	0.00
314	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
315	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
316	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
317	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
318	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
319	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
320	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
321	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
322	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
323	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
324	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
325	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
326	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
327	003023	彩虹集团	296	8,968.80	0.00
328	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
329	003004	声迅股份	306	8,613.90	0.00
330	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
331	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00

332	605155	西大门	350	7,696.50	0.00
333	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
334	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	603986	兆易创新	1,698,871,132.78	5.18
2	002371	北方华创	1,048,100,679.18	3.20
3	603501	韦尔股份	840,289,467.07	2.56
4	600703	三安光电	729,767,340.10	2.23
5	300782	卓胜微	642,364,591.83	1.96
6	688981	中芯国际	427,479,755.20	1.30
7	300280	紫天科技	327,947,149.61	1.00
8	300567	精测电子	319,980,629.15	0.98
9	300457	赢合科技	315,548,617.62	0.96
10	603259	药明康德	300,373,908.83	0.92
11	300750	宁德时代	299,988,745.93	0.92
12	000661	长春高新	299,893,899.20	0.91
13	688019	安集科技	274,144,414.07	0.84
14	688012	中微公司	177,978,074.05	0.54
15	300655	晶瑞电材	161,715,969.41	0.49
16	002324	普利特	144,559,552.82	0.44
17	688126	沪硅产业	143,230,536.26	0.44
18	300223	北京君正	107,092,207.52	0.33
19	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.01
20	688819	天能股份	1,186,083.78	0.00

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	3,063,418,000.13	9.35
2	603986	兆易创新	3,027,022,997.49	9.24
3	300782	卓胜微	2,638,971,039.01	8.05
4	603501	韦尔股份	2,367,586,241.66	7.22
5	600703	三安光电	2,078,915,159.88	6.34
6	600584	长电科技	1,521,556,645.72	4.64
7	688981	中芯国际	1,321,862,959.28	4.03
8	603005	晶方科技	782,594,294.38	2.39
9	688019	安集科技	331,069,312.04	1.01
10	600641	万业企业	318,911,494.65	0.97
11	300567	精测电子	313,449,313.87	0.96
12	300750	宁德时代	299,535,046.85	0.91
13	000661	长春高新	285,082,763.55	0.87
14	603259	药明康德	281,888,842.16	0.86
15	605111	新洁能	269,862,927.06	0.82
16	300655	晶瑞电材	63,940,991.40	0.20
17	300223	北京君正	28,760,047.42	0.09
18	688012	中微公司	24,714,505.00	0.08
19	688126	沪硅产业	10,739,262.83	0.03
20	600905	三峡能源	3,126,338.00	0.01

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	8,273,386,373.20
卖出股票收入（成交）总额	19,041,152,394.13

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 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	4,212,543.52
2	应收证券清算款	533,915,600.50
3	应收股利	-
4	应收利息	139,488.16
5	应收申购款	401,329,383.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	939,597,015.34
---	----	----------------

#### 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
2,463,625	5,353.24	162,575,088.80	1.23%	13,025,790,018.98	98.77%

#### 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	14,140,072.21	0.1072%

#### 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、基金投资和研发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	>100

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年03月10日)基金份额总额	1,167,838,082.92
本报告期期初基金份额总额	18,956,430,702.08
本报告期基金总申购份额	20,173,494,673.23
减：本报告期基金总赎回份额	25,941,560,267.53

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	13,188,365,107.78

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，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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，本基金托管人及其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	

东北证券	1	4,188,496,008.51	15.34%	3,900,729.27	18.82%	-
新时代证券	1	3,272,727,638.83	11.99%	3,047,896.98	14.71%	-
华西证券	1	3,093,438,143.59	11.33%	2,200,350.97	10.62%	-
中信证券	2	2,981,684,298.51	10.92%	2,717,210.41	13.11%	-
华创证券	1	2,813,699,756.60	10.31%	2,620,400.32	12.65%	-
西部证券	1	2,730,298,081.22	10.00%	1,122,961.42	5.42%	-
东方财富	1	2,447,416,137.23	8.96%	1,006,622.81	4.86%	-
长江证券	2	2,425,528,504.06	8.88%	1,725,264.91	8.33%	-
国盛证券	1	1,828,038,494.86	6.70%	1,300,283.86	6.27%	-
华宝证券	1	1,519,152,001.35	5.56%	1,080,612.73	5.21%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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4个证券公司4个交易单元：安信证券股份有限公司（1个交易单元），华宝证券股份有限公司（1个交易单元），中信证券股份有限公司（1个交易单元），长江证券股份有限公司（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



的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
东北证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	965,931,311.50	43.06%	-	-	-	-
中信证券	700,108,635.30	31.21%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	288,399,019.30	12.86%	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	288,657,831.30	12.87%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 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》	2021-01-04
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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-05
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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-06
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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-16
6	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
7	诺安成长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
8	诺安成长混合型证券投资基金招募说明书、	《上海证券报》	2021-02-05

	基金产品资料概要（更新）的提示性公告		
9	诺安成长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	2021-02-05
10	诺安成长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	2021-02-05
11	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》、 《证券日报》	2021-02-08
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	诺安成长混合型证券投资基金2020年年度报	基金管理人网站	2021-03-31

	告		
18	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
19	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
20	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
21	诺安成长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
22	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
23	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
24	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
25	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》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-21
26	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》	2021-06-26

27	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
28	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成长股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安成长混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安成长混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安成长股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥诺安成长混合型证券投资基金2021年中期报告正文。

⑦报告期内诺安成长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](http://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