

# 诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	20
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>61</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	71

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	74
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>75</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4 基金投资策略的改变 .....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	84
13.3 查阅方式 .....	84

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金	
基金简称	诺德量化蓝筹	
基金主代码	005082	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 29 日	
基金管理人	诺德基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	118,986,067.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
下属分级基金的交易代码:	005082	005083
报告期末下属分级基金的份额总额	90,669.93 份	118,895,397.43 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将运用长期资产配置（SAA）和短期资产配置（TAA）相结合的方法，根据市场环境的变化，合理确定基金在股票、债券及货币市场工具等各类资产类别上的投资比例。在长期资产配置保持稳定增值的前提下，积极进行短期资产灵活配置，构建在承受适当风险的前提下可获取较高收益的资产组合。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈培阳	韩鑫普
	联系电话	021-68985266	0755-82943666
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0009	95565
传真		021-68985121	0755-82960794
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		200120	518000

法定代表人	潘福祥	霍达
-------	-----	----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
注册登记机构	诺德基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
本期已实现收益	1,404,375.13	35,812,208.76	2,398,656.02	33,792,627.95	484.36	3,936,466.10
本期利润	1,583,729.39	12,913,877.37	4,044,562.41	47,301,656.44	1,450.43	9,867,802.35
加权平均基金份额本期利润	0.2260	0.0713	0.3481	0.2177	0.1194	0.1372
本期加权平均	20.14%	6.33%	33.52%	22.26%	13.53%	15.62%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	7.12%	8.30%	19.84%	19.74%	12.00%	11.89%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	9,715.57	13,730,731.74	-1,705,611.50	-17,495,232.67	-2,474.70	-34,874,312.87
期末可供分配基金份额利润	0.1072	0.1155	-0.0779	-0.0817	-0.2224	-0.2250

期末基金资产净值	107,347.73	141,749,738.88	24,205,760.07	235,787,188.30	10,259.76	142,519,264.37
期末基金份额净值	1.1839	1.1922	1.1052	1.1008	0.9222	0.9193
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	18.39%	19.22%	10.52%	10.08%	-7.78%	-8.07%

注：1、 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。

2、 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺德量化蓝筹 A

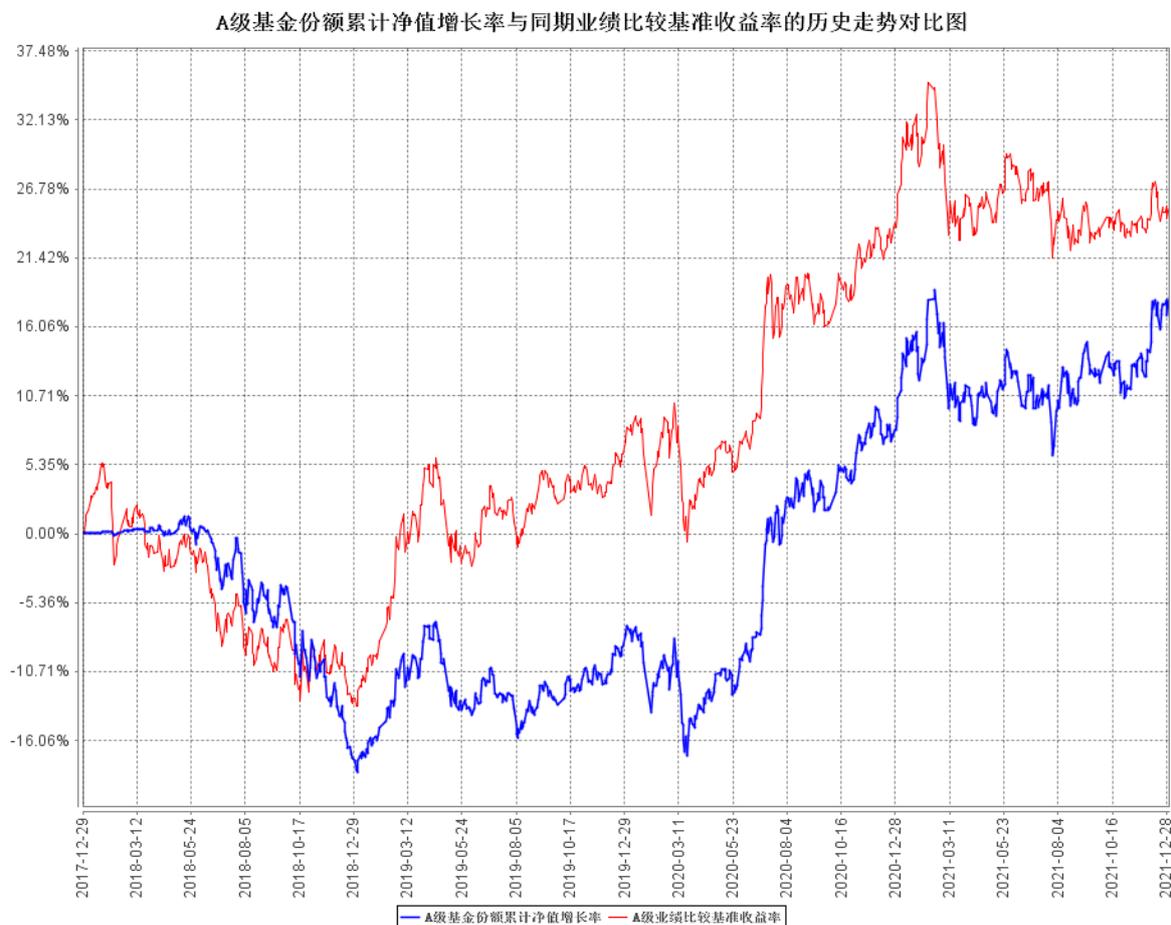
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.57%	0.66%	1.46%	0.47%	4.11%	0.19%
过去六个月	5.83%	0.76%	-2.00%	0.61%	7.83%	0.15%
过去一年	7.12%	0.79%	-0.76%	0.70%	7.88%	0.09%
过去三年	43.78%	0.76%	43.69%	0.77%	0.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	18.39%	0.74%	25.36%	0.78%	-6.97%	-0.04%

诺德量化蓝筹 C

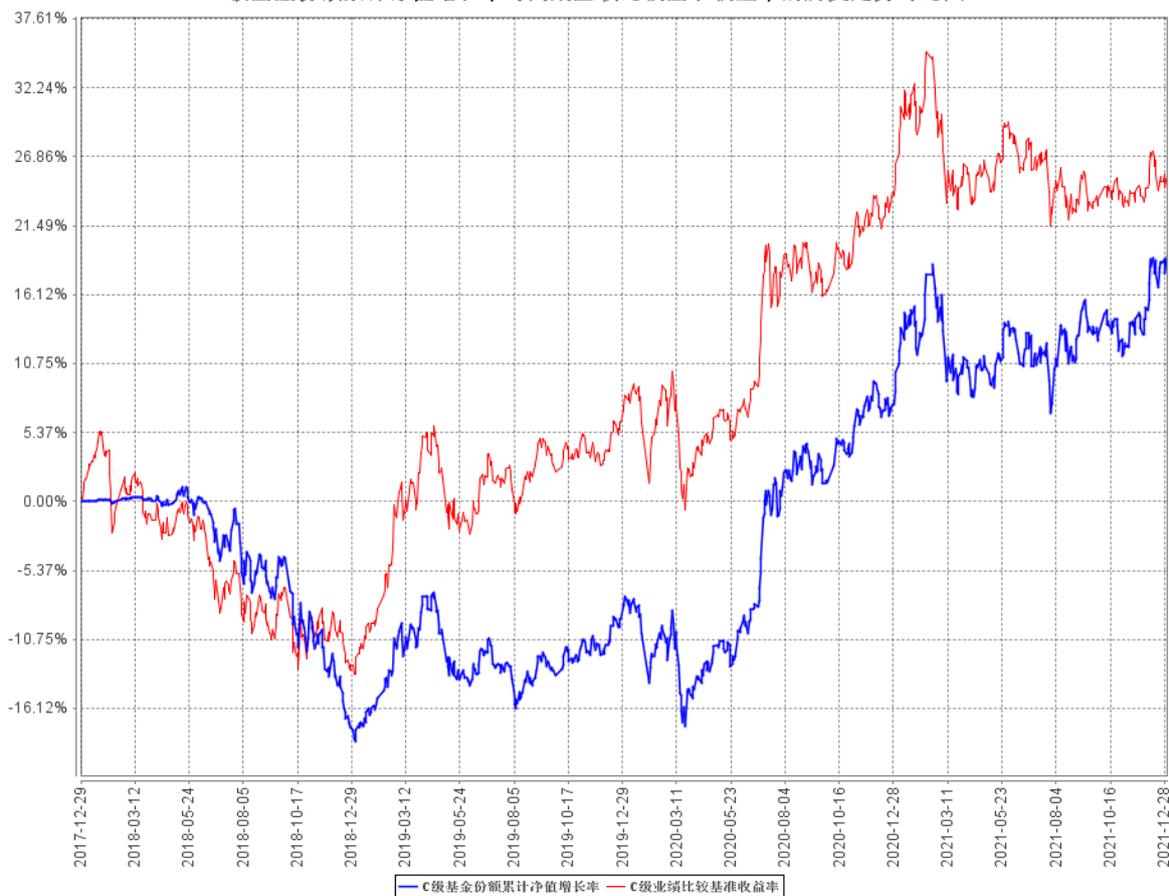
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.55%	0.66%	1.46%	0.47%	4.09%	0.19%
过去六个月	5.79%	0.77%	-2.00%	0.61%	7.79%	0.16%
过去一年	8.30%	0.79%	-0.76%	0.70%	9.06%	0.09%
过去三年	45.11%	0.76%	43.69%	0.77%	1.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	19.22%	0.74%	25.36%	0.78%	-6.14%	-0.04%

注：业绩比较基准为沪深 300 指数收益率\*60%+中证综合债券指数收益率\*40%

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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

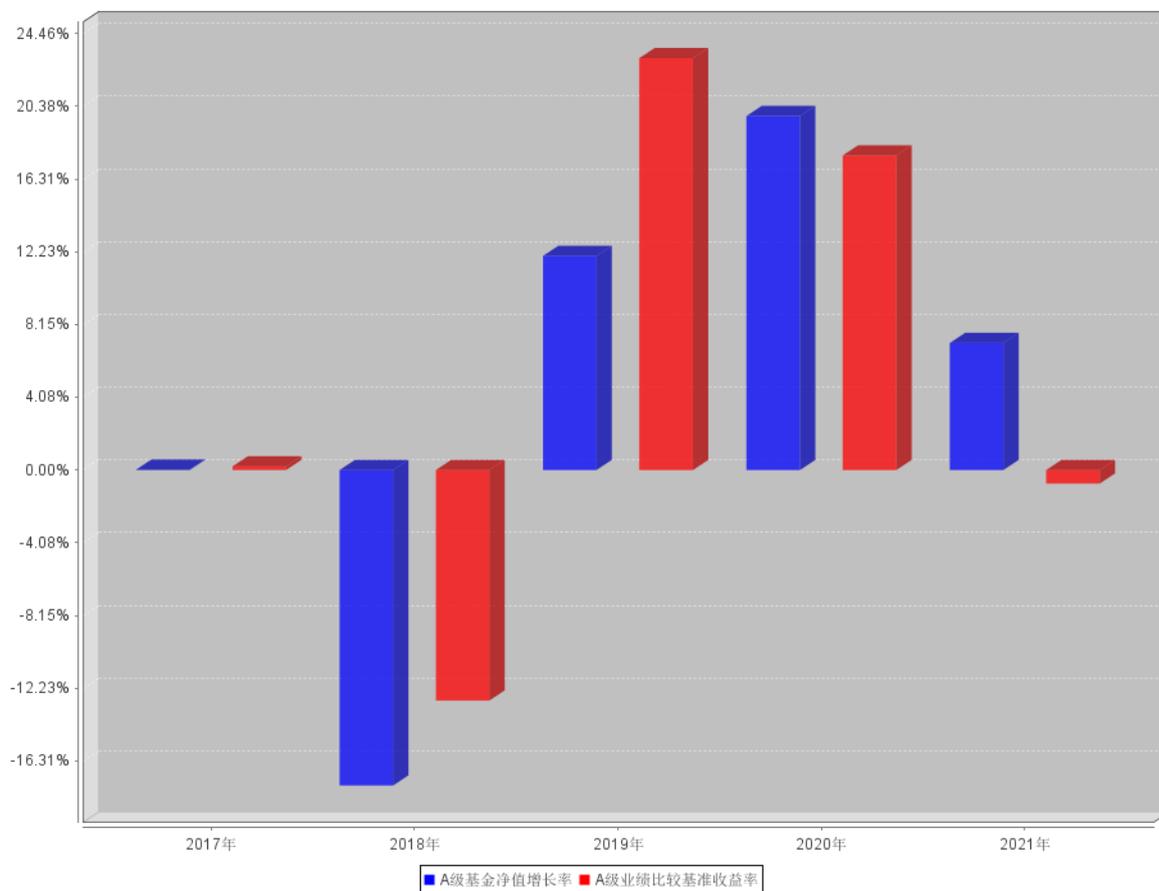


注：本基金的合同于 2017 年 12 月 29 日生效，图示时间段为 2017 年 12 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日。

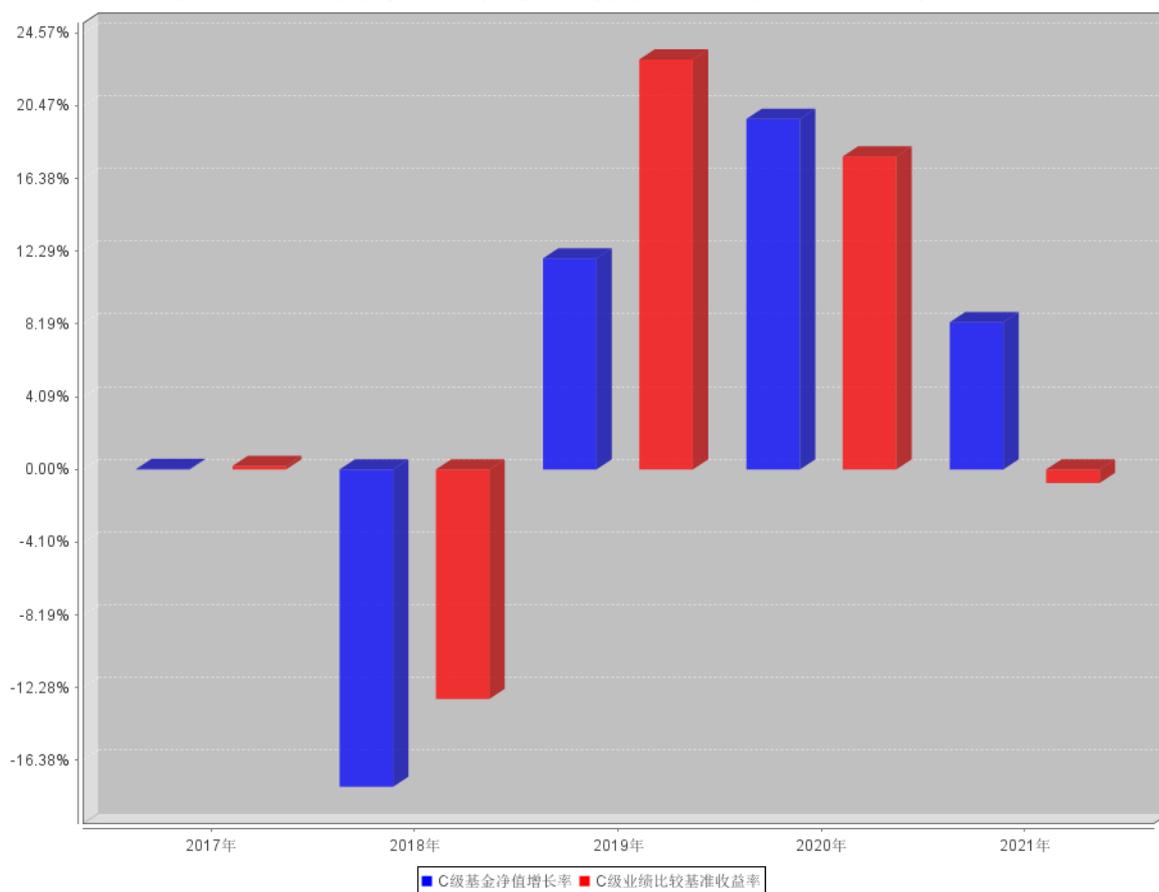
本基金建仓期间自 2017 年 12 月 29 日至 2018 年 6 月 28 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的合同于 2017 年 12 月 29 日生效，图示时间段为 2017 年 12 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日基金净值增长率与业绩基准收益率比较。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2017 年 12 月 29 日，自基金合同生效以来未发生利润分配事项。

## § 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

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了三十二只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金。

#### 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		
曾文宏	本基金基金经理以及诺德天富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年12月29日	-	9	华中师范大学数量经济学硕士。2012年6月至2014年7月于上海大智慧股份有限公司担任行业研究员兼产品经理，2014年7月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业

					部高级研究员, FOF 管理部投资经理等职务, 具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	-----------------------------------

注: 1、对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日; 除首任基金经理外, “任职日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期; “离任日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

不适用。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在认真控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋取最大利益, 没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为保证各类受托投资资金的安全, 保证本公司各项资产管理业务的正常运行, 维护投资者的合法权益, 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定, 基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》, 确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合, 严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送, 其规范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, 同时包括授权、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。具体的控制措施包括:

一、实施信息隔离制度: 公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度, 不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;

二、公平分享研究分析报告: 所有研究报告均在公司内网平台上发布, 但是禁止在其他公开渠道发布, 各组合经理同步获取研究分析报告资料;

三、严格控制同日反向交易: 原则上禁止不同投资组合之间的同日反向交易, 确实由于投资

组合的投资决策或流动性等需要而发生的同日反向交易，相关投资组合经理应向投资决策委员会提供决策依据并留存记录备案；

四、公平执行交易指令：（1）交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关；（2）不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，对于需要分配交易量的交易，应当填写《公平交易审批表》，按比例分配的原则实施分配，保证不同投资组合获得公平的交易机会；（3）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室应按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易，应当实施公平性审核，填写《公平交易审批表》，报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

五、实施事前审核和事后稽核：公司风险管理部门根据市场公认的第三方信息对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行事前审查，对公平交易的不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行事中监控，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行事后分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本公司在 2021 年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经 T 检验分析和贡献率分析，本投资组合与其他投资组合日内、3 日内、5 日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况，也未发现其他存在利益输送的情况。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不适用。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金与其它组合之间未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

## 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 年国内宏观经济处于复苏见顶伴随结构转型升级的过程中。就股票二级市场而言，2021 年具体表现为：上证综指涨幅 4.8%，上证 50 跌幅 10.06%，沪深 300 指数跌幅 5.2%，中证 500 指数涨幅 15.58%，创业板指数涨幅 12.02%，指数层面全年中小市值风格占优。

2021 年度本基金通过量化模型选择蓝筹股票，同时结合行业配置策略、个股精选策略等，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇。坚守价值投资理念的同时，本基金主要采用量化技术手段，争取获取超越业绩基准的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，诺德量化蓝筹 A 类份额净值为 1.1839 元，累计净值为 1.1839 元。本报告期份额净值增长率为 7.12%，同期业绩比较基准增长率为-0.76%。诺德量化蓝筹 C 类份额净值为 1.1922 元，累计净值为 1.1922 元。本报告期份额净值增长率为 8.30%，同期业绩比较基准增长率为-0.76%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济整体依旧处于构筑底部的大背景中，从基本上，我们看出中国的宏观经济表现出了较好的韧性，疫情在中国得到了很好的控制，经济恢复情况较好。国际层面上来说，美国经济冲顶迹象明显，美国通胀的高企有难以控制的可能，美联储货币收紧时点值得关注。我们认为在 2022 年 A 股市场依旧存在机会，将继续关注业绩反转和业绩超预期的公司，同时需要注意回避业绩可能存疑的个股。我们认为价值股回归的同时，科创板和创业板在进一步调整之后依然有不错的机会，操作上注意规避业绩存疑的个股，关注真正能成长起来的公司，有望获得超额回报。全年来看，预计 2022 年国企改革真正落实的相关标的，以及资本市场改革背景下，券商行业以及核心资产中业绩和估值匹配的龙头股票，其投资机会都有可能贯穿 2022 整年。

本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度，以低估值蓝筹配置为主，适当关注业绩逐步体现的成长公司，主要通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。2022 年可能是经济回落的一年，不一定会有整体系统性的行情，但是阶段和个股机会依旧精彩，本基金将力争抓住结构性的机会，努力为投资者创造更好的回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从保障基金份额持有人利益出发，继续加强了公司内部控制制度体系的建设，积极开展了风险管理及合规培训。公司内部设立专门的监察稽核部门，负责督促投

资研究、市场营销、运营保障等业务部门合规运作，并实施定期和不定期检查，确保各项法规和公司管理制度的有效落实，发现潜在违规风险及时与相关业务部门沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具监察稽核报告。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据公司业务发展情况以及基金监管法律、法规的要求，推动公司各部门完善规章制度和业务流程建设，确保基金投资研究、销售及运营保障的制度化、规范化。

(2) 全面开展了监察稽核工作，保证了公司和基金在合法合规前提下进行投资运作。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，加强了对投资运作的事前、事中及事后的风险控制，确保了本基金在报告期内未出现违法违规的投资行为。

(3) 报告期内，通过各部门的积极参与，重点对投资管理人员管理、投资监控措施、基金销售适用性、反洗钱工作等实际业务运作中存在的潜在风险点进行了梳理、检查，有效地防止了基金和公司投资运作和经营方面的风险。

(4) 根据监管部门的要求，完成定期的监察稽核报告及专项监察报告，及时报送中国证监会和董事会审阅。

报告期内，本基金管理人各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用；本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续贯彻内控优先的经营理念，进一步完善公司内部控制制度体系，加强对公司投资研究、市场营销、运营保障等环节的风险点识别及控制，提高内部监察工作的科学性和有效性，保障基金在合法合规前提下的有效运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为了确保基金估值严格执行新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，更好地保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人制定并修订了《诺德基金管理有限公司证券投资基金估值制度》（以下简称“估值制度”。）

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经验。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中：

基金会计主管主要负责制定新的估值政策、方法和程序，提供相关的会计数据，并具体负责和会计事务所及基金托管行就估值模型、假设及参数进行沟通，以支持委员会的相关决定；

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

投资总监主要负责分析市场情况，并在结合相关行业研究员意见的基础上对具体投资品种所处的经济环境和相关重大事项进行判断；

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

根据估值制度，估值委员会成员中不包括基金经理。本报告期内，上述参与流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## § 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24360 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(以下简称“诺德量化蓝筹增强基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了诺德量化蓝筹增强基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于诺德量化蓝筹增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>诺德量化蓝筹增强基金的基金管理人诺德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估诺德量化蓝筹增强</p>

	<p>基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算诺德量化蓝筹增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺德量化蓝筹增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对诺德量化蓝筹增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺德量化蓝筹增强基金不能持续经营。</p>

	<p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,432,960.56	18,832,464.56
结算备付金		31,069.30	32,762,798.94
存出保证金		69,314.36	67,206.23
交易性金融资产	7.4.7.2	132,517,735.10	182,697,820.93
其中：股票投资		132,517,735.10	182,697,820.93
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		131,105.15	26,162,096.11
应收利息	7.4.7.5	1,017.43	32,174.70
应收股利		-	-
应收申购款		2,901.02	13,258.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		142,186,102.92	260,567,820.02
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,784.06	184,749.25
应付管理人报酬		68,539.01	144,608.91
应付托管费		11,423.16	24,101.48
应付销售服务费		9,131.29	17,678.27
应付交易费用	7.4.7.7	57,138.77	23,733.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,000.02	180,000.34
负债合计		329,016.31	574,871.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	118,986,067.36	236,098,500.91
未分配利润	7.4.7.10	22,871,019.25	23,894,447.46
所有者权益合计		141,857,086.61	259,992,948.37
负债和所有者权益总计		142,186,102.92	260,567,820.02

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 118,986,067.36 份，其中 A 类基金份额净值 1.1839 元，基金份额 90,669.93 份；C 类基金份额净值 1.1922 元，基金份额 118,895,397.43 份。

## 7.2 利润表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		16,879,816.38	53,663,893.70
1.利息收入		355,074.25	999,126.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	310,152.47	592,149.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		44,921.78	406,976.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,159,133.92	37,504,331.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	35,528,312.55	34,311,830.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,630,821.37	3,192,501.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-22,718,977.13	15,154,934.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	84,585.34	5,500.98

列)			
<b>减：二、费用</b>		2,382,209.62	2,317,674.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,279,332.40	1,336,412.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	213,222.05	222,735.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	164,078.73	168,727.79
4. 交易费用	7.4.7.19	532,836.52	392,022.78
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	7.4.7.20	192,739.92	197,776.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,497,606.76	51,346,218.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,497,606.76	51,346,218.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	236,098,500.91	23,894,447.46	259,992,948.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,497,606.76	14,497,606.76
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）	-117,112,433.55	-15,521,034.97	-132,633,468.52
其中：1. 基金申购款	382,791,376.94	47,278,800.96	430,070,177.90
2. 基金赎回款	-499,903,810.49	-62,799,835.93	-562,703,646.42
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	118,986,067.36	22,871,019.25	141,857,086.61

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	155,040,303.11	-12,510,778.98	142,529,524.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,346,218.85	51,346,218.85
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）	81,058,197.80	-14,940,992.41	66,117,205.39
其中：1. 基金申购款	213,497,210.86	-17,920,059.25	195,577,151.61
2. 基金赎回款	-132,439,013.06	2,979,066.84	-129,459,946.22
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）	236,098,500.91	23,894,447.46	259,992,948.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          罗凯                                          罗凯                                          高奇            
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(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[2017]1409号《关于准予诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德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《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币205,779,736.73元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第1104号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月29日正式生效,

基金合同生效日的基金份额总额为 205,820,281.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 40,544.40 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资者可自行选择基金份额类别进行认购/申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化蓝筹增强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上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、股指期货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的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 50%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有

关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及

其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	9,432,960.56	18,832,464.56
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：	9,432,960.56	18,832,464.56

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	134,258,543.43	132,517,735.10	-1,740,808.33
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	134,258,543.43	132,517,735.10	-1,740,808.33
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	161,719,652.13	182,697,820.93	20,978,168.80
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	161,719,652.13	182,697,820.93	20,978,168.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	967.49	3,350.35
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	15.62	37,084.98
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	-	-8,293.85
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	34.32	33.22

合计	1,017.43	32,174.70
----	----------	-----------

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	57,138.77	23,733.40
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	57,138.77	23,733.40

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.02	0.34
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,000.02	180,000.34

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

诺德量化蓝筹 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,902,259.14	21,902,259.14
本期申购	18,553,329.65	18,553,329.65
本期赎回（以“-”号填列）	-40,364,918.86	-40,364,918.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	90,669.93	90,669.93

金额单位：人民币元

诺德量化蓝筹 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,196,241.77	214,196,241.77
本期申购	364,238,047.29	364,238,047.29
本期赎回（以“-”号填列）	-459,538,891.63	-459,538,891.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	118,895,397.43	118,895,397.43

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

诺德量化蓝筹 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,705,611.50	4,009,112.43	2,303,500.93
本期利润	1,404,375.13	179,354.26	1,583,729.39
本期基金份额交易产生的变动数	310,951.94	-4,181,504.46	-3,870,552.52
其中：基金申购款	-887,563.90	2,703,887.73	1,816,323.83
基金赎回款	1,198,515.84	-6,885,392.19	-5,668,876.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,715.57	6,962.23	16,677.80

单位：人民币元

诺德量化蓝筹 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-17,495,232.67	39,086,179.20	21,590,946.53
本期利润	35,812,208.76	-22,898,331.39	12,913,877.37
本期基金份额交易产生的变动数	-4,586,244.35	-7,064,238.10	-11,650,482.45
其中：基金申购款	6,085,487.82	39,376,989.31	45,462,477.13
基金赎回款	-10,671,732.17	-46,441,227.41	-57,112,959.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,730,731.74	9,123,609.71	22,854,341.45

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	135,506.52	290,552.39
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	163,034.12	291,481.72
其他	11,611.83	10,115.87
合计	310,152.47	592,149.98

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	191,247,682.16	102,588,361.71
减：卖出股票成本总额	155,719,369.61	68,276,531.71
买卖股票差价收入	35,528,312.55	34,311,830.00

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益—买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益—赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,630,821.37	3,192,501.60
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,630,821.37	3,192,501.60

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年
------	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-22,718,977.13	15,154,934.88
——股票投资	-22,718,977.13	15,154,934.88
——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	-22,718,977.13	15,154,934.88

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	82,643.58	5,079.86
转换费收入	79.88	359.79
其他	1,861.88	61.33
合计	84,585.34	5,500.98

注：

1. 本基金 A 类基金份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对持续持有基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于 30 日(含)但少于 90 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有基金份额长于 90 日(含)但少于 180 日(含)的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产。
2. 本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。
3. 本基金的转换费用由申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	532,836.52	392,022.78
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	532,836.52	392,022.78

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	12,739.92	17,776.03
合计	192,739.92	197,776.03

#### 7.4.7.21 分部报告

不适用。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
清华控股有限公司（“清华控股”）	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理（北京）有限公司（“宜信惠民”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,279,332.40	1,336,412.75
其中：支付销售机构的客户维护费	50,610.00	2,989.65

注：支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	213,222.05	222,735.50

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	合计
诺德基金	-	149,394.85	149,394.85
合计	-	149,394.85	149,394.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	合计
诺德基金	-	167,953.47	167,953.47
合计	-	167,953.47	167,953.47

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给诺德基金，再由诺德基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.10%/ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	517,241.38
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	517,241.38
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
688789	宏华数科	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688075	安旭生物	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 18 日	新股流通受限	78.28	128.77	1,421	111,235.88	182,982.17	-
688737	中自科技	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 22 日	新股流通受限	70.90	55.06	902	63,951.80	49,664.12	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688701	卓锦股份	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股流通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
301099	雅创电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-

		日	23 日								
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	3.55	18.24	1,361	4,831.55	24,824.64	-	
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-	
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-	
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-	
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-	
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新股流通受限	60.66	96.75	153	9,280.98	14,802.75	-	
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股流通受限	22.04	56.28	258	5,686.32	14,520.24	-	
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-	
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301185	鸥玛	2021 年	2022	新股流	11.88	21.16	565	6,712.20	11,955.40	-	

	软件	11月11日	2021年5月19日	通受限							
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	583	7,579.00	11,939.84		-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	929	6,465.84	11,621.79		-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	231	5,243.70	11,323.62		-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	771	3,184.23	9,992.16		-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50		-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	131	12,194.79	9,869.54		-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	852	8,903.40	9,559.44		-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52		-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91		-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84		-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23		-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64		-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	477	5,738.31	8,166.24		-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64		-

301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	66	7,714.08	7,661.28	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	208	5,366.40	6,999.20	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	216	4,700.16	6,307.20	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	145	3,901.95	6,287.20	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	137	3,585.29	6,145.82	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

			24 日							
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股流通受限	69.89	88.72	60	4,193.40	5,323.20	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流通受限	58.08	49.85	103	5,982.24	5,134.55	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	19.34	32.92	152	2,939.68	5,003.84	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流通受限	36.31	35.52	138	5,010.78	4,901.76	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流通受限	29.28	32.00	150	4,392.00	4,800.00	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流通受限	39.08	52.13	82	3,204.56	4,274.66	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股流通受限	27.81	31.14	135	3,754.35	4,203.90	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地	2021 年	2022	新股流	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-

	海洋	9月16日	2021年3月28日	通受限						
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	130	3,525.60	3,975.40	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	70	4,008.90	3,759.70	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	132	3,676.20	3,624.72	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	63	4,169.34	3,567.06	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	66	2,903.34	3,350.82	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	38	3,024.80	2,984.14	-

注:1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动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内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：（1）决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；（2）执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；（3）监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、稽核风控部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有托管资质的招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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证

券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.89%。

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。于本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,432,960.56	-	-	-	-	-	9,432,960.56
结算备付金	31,069.30	-	-	-	-	-	31,069.30
存出保证金	69,314.36	-	-	-	-	-	69,314.36

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-132,517,735.10	132,517,735.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	131,105.15	131,105.15
应收利息	-	-	-	-	-	1,017.43	1,017.43
应收申购款	-	-	-	-	-	2,901.02	2,901.02
资产总计	9,533,344.22	-	-	-	-	-132,652,758.70	142,186,102.92
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,784.06	2,784.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	68,539.01	68,539.01
应付托管费	-	-	-	-	-	11,423.16	11,423.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,131.29	9,131.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	57,138.77	57,138.77
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.02	180,000.02
负债总计	-	-	-	-	-	329,016.31	329,016.31
利率敏感度缺口	9,533,344.22	-	-	-	-	-132,323,742.39	141,857,086.61
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	18,832,464.56	-	-	-	-	-	18,832,464.56
结算备付金	32,762,798.94	-	-	-	-	-	32,762,798.94
存出保证金	67,206.23	-	-	-	-	-	67,206.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-182,697,820.93	182,697,820.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-26,162,096.11	26,162,096.11
应收利息	-	-	-	-	-	32,174.70	32,174.70
应收申购款	-	-	-	-	-	13,258.55	13,258.55
资产总计	51,662,469.73	-	-	-	-	-208,905,350.29	260,567,820.02
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	184,749.25	184,749.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	144,608.91	144,608.91
应付托管费	-	-	-	-	-	24,101.48	24,101.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,678.27	17,678.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,733.40	23,733.40
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.34	180,000.34
负债总计	-	-	-	-	-	574,871.65	574,871.65
利率敏感度缺口	51,662,469.73	-	-	-	-	-208,330,478.64	259,992,948.37

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中股票投资占基金资产的 50%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	132,517,735.10	93.42	182,697,820.93	70.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	132,517,735.10	93.42	182,697,820.93	70.27

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,501,834.64	7,361,700.33
	沪深 300 指数下降 5%	-4,501,834.64	-7,361,700.33

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 131,254,653.61 元，属于第二层次的余额为 5,504.49 元，属于第三层次的余额为 1,257,577.00 元（2020 年 12 月 31 日：第一层次 180,318,681.55 元，第二层次 2,379,139.38 元，无第三层次）。

##### (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，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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 1,257,577.00 元(2020 年 12 月 31 日：无)。于 2021 年度，本基金购买第三层次金融工具 505,711.17 元(2020 年度：无)，计入当期损益的利得或损失(公允价值变动损益等项目)的金额为 751,865.83 元(2020 年度：无)，2021 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融工具计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额(公允价值变动损益)为 751,865.83 元(2020 年度：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融工具均为股票投资，公允价值为 1,257,577.00 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募

证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	132,517,735.10	93.20
	其中：股票	132,517,735.10	93.20
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	9,464,029.86	6.66
8	其他各项资产	204,337.96	0.14
9	合计	142,186,102.92	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,879,746.00	3.44
B	采矿业	6,348,787.80	4.48
C	制造业	62,001,568.65	43.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,747,498.00	1.94
E	建筑业	5,383,547.80	3.80
F	批发和零售业	1,200,024.08	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,173,948.00	1.53
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,480,258.97	5.27
J	金融业	30,353,856.84	21.40
K	房地产业	5,515,307.00	3.89
L	租赁和商务服务业	859,900.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	1,640,492.71	1.16

N	水利、环境和公共设施管理业	59,659.47	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	58,164.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,074,953.14	0.76
R	文化、体育和娱乐业	735,414.64	0.52
S	综合	-	-
	合计	132,517,735.10	93.42

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	166,400	4,394,624.00	3.10
2	601166	兴业银行	180,000	3,427,200.00	2.42
3	601318	中国平安	56,700	2,858,247.00	2.01
4	300059	东方财富	74,200	2,753,562.00	1.94
5	000858	五粮液	11,900	2,649,654.00	1.87
6	600887	伊利股份	56,700	2,350,782.00	1.66
7	000651	格力电器	60,000	2,221,800.00	1.57
8	600519	贵州茅台	1,000	2,050,000.00	1.45
9	601668	中国建筑	409,600	2,048,000.00	1.44
10	600048	保利发展	130,000	2,031,900.00	1.43
11	300761	立华股份	50,000	1,890,500.00	1.33
12	000603	盛达资源	150,000	1,887,000.00	1.33
13	002237	恒邦股份	160,000	1,870,400.00	1.32
14	600036	招商银行	38,000	1,850,980.00	1.30
15	600104	上汽集团	87,100	1,796,873.00	1.27
16	601939	建设银行	300,000	1,758,000.00	1.24
17	000333	美的集团	23,000	1,697,630.00	1.20
18	601139	深圳燃气	180,000	1,589,400.00	1.12
19	002415	海康威视	30,000	1,569,600.00	1.11
20	002475	立讯精密	31,800	1,564,560.00	1.10
21	000725	京东方 A	300,000	1,515,000.00	1.07
22	300567	精测电子	20,000	1,448,600.00	1.02
23	601601	中国太保	50,100	1,358,712.00	0.96
24	002385	大北农	120,000	1,258,800.00	0.89

25	600309	万华化学	12,000	1,212,000.00	0.85
26	000063	中兴通讯	36,000	1,206,000.00	0.85
27	000001	平安银行	73,100	1,204,688.00	0.85
28	601117	中国化学	100,000	1,200,000.00	0.85
29	603337	杰克股份	50,000	1,172,500.00	0.83
30	601988	中国银行	372,800	1,137,040.00	0.80
31	600900	长江电力	50,000	1,135,000.00	0.80
32	601108	财通证券	100,000	1,112,000.00	0.78
33	601088	中国神华	48,300	1,087,716.00	0.77
34	601766	中国中车	175,800	1,070,622.00	0.75
35	002714	牧原股份	20,000	1,067,200.00	0.75
36	600690	海尔智家	35,500	1,061,095.00	0.75
37	600737	中粮糖业	110,000	1,034,000.00	0.73
38	600276	恒瑞医药	20,344	1,031,644.24	0.73
39	600380	健康元	80,000	1,027,200.00	0.72
40	600028	中国石化	242,200	1,024,506.00	0.72
41	300124	汇川技术	14,850	1,018,710.00	0.72
42	002241	歌尔股份	18,600	1,006,260.00	0.71
43	000002	万科 A	50,000	988,000.00	0.70
44	300381	溢多利	80,000	949,600.00	0.67
45	601398	工商银行	200,000	926,000.00	0.65
46	300498	温氏股份	47,100	907,146.00	0.64
47	600585	海螺水泥	22,500	906,750.00	0.64
48	601211	国泰君安	50,500	903,445.00	0.64
49	601288	农业银行	300,000	882,000.00	0.62
50	000338	潍柴动力	47,900	856,931.00	0.60
51	600588	用友网络	23,400	839,592.00	0.59
52	000776	广发证券	33,400	821,306.00	0.58
53	600315	上海家化	20,000	808,200.00	0.57
54	002153	石基信息	28,000	804,720.00	0.57
55	601899	紫金矿业	81,900	794,430.00	0.56
56	600019	宝钢股份	110,600	791,896.00	0.56
57	601336	新华保险	20,000	777,600.00	0.55
58	601857	中国石油	154,500	758,595.00	0.53
59	600895	张江高科	50,000	753,000.00	0.53
60	601390	中国中铁	130,000	752,700.00	0.53
61	000100	TCL 科技	121,100	747,187.00	0.53
62	002311	海大集团	10,000	733,000.00	0.52
63	002299	圣农发展	30,000	725,100.00	0.51

64	300348	长亮科技	45,000	705,150.00	0.50
65	002352	顺丰控股	10,000	689,200.00	0.49
66	300624	万兴科技	12,000	661,320.00	0.47
67	603993	洛阳钼业	116,700	651,186.00	0.46
68	601186	中国铁建	83,000	647,400.00	0.46
69	600738	丽尚国潮	105,000	638,400.00	0.45
70	300284	苏交科	100,000	637,000.00	0.45
71	600893	航发动力	10,000	634,600.00	0.45
72	002736	国信证券	54,508	625,751.84	0.44
73	002236	大华股份	25,900	608,132.00	0.43
74	600000	浦发银行	70,300	599,659.00	0.42
75	600763	通策医疗	3,000	597,000.00	0.42
76	603986	兆易创新	3,360	590,856.00	0.42
77	300750	宁德时代	1,000	588,000.00	0.41
78	601012	隆基股份	6,800	586,160.00	0.41
79	603538	美诺华	16,500	585,915.00	0.41
80	300413	芒果超媒	10,000	572,200.00	0.40
81	601818	光大银行	169,900	564,068.00	0.40
82	300347	泰格医药	4,400	562,320.00	0.40
83	002594	比亚迪	2,000	536,240.00	0.38
84	002867	周大生	30,000	533,400.00	0.38
85	600660	福耀玻璃	11,300	532,682.00	0.38
86	688111	金山办公	2,000	530,000.00	0.37
87	000768	中航西飞	14,200	518,300.00	0.37
88	300122	智飞生物	4,100	510,860.00	0.36
89	002179	中航光电	5,000	502,800.00	0.35
90	000538	云南白药	4,800	502,320.00	0.35
91	688023	安恒信息	2,000	501,480.00	0.35
92	002493	荣盛石化	27,450	498,492.00	0.35
93	002304	洋河股份	3,000	494,190.00	0.35
94	601111	中国国航	54,000	493,020.00	0.35
95	300613	富瀚微	3,000	489,150.00	0.34
96	600196	复星医药	9,900	484,506.00	0.34
97	601628	中国人寿	16,100	484,449.00	0.34
98	600009	上海机场	10,100	471,569.00	0.33
99	600031	三一重工	20,000	456,000.00	0.32
100	600438	通威股份	10,000	449,600.00	0.32
101	600362	江西铜业	20,000	446,600.00	0.31
102	000166	申万宏源	85,800	439,296.00	0.31

103	002460	赣锋锂业	3,000	428,550.00	0.30
104	600663	陆家嘴	39,100	424,626.00	0.30
105	002008	大族激光	7,800	421,200.00	0.30
106	001979	招商蛇口	31,400	418,876.00	0.30
107	002027	分众传媒	50,000	409,500.00	0.29
108	601989	中国重工	95,600	403,432.00	0.28
109	002878	元隆雅图	20,000	394,000.00	0.28
110	600160	巨化股份	30,000	387,300.00	0.27
111	600050	中国联通	98,000	385,140.00	0.27
112	300454	深信服	2,000	382,000.00	0.27
113	300271	华宇软件	30,000	381,000.00	0.27
114	000625	长安汽车	25,060	380,661.40	0.27
115	600703	三安光电	10,000	375,600.00	0.26
116	002624	完美世界	18,300	371,673.00	0.26
117	002410	广联达	5,800	371,084.00	0.26
118	000623	吉林敖东	20,000	369,400.00	0.26
119	002600	领益智造	50,000	368,000.00	0.26
120	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.26
121	002043	兔宝宝	30,000	362,400.00	0.26
122	600170	上海建工	100,000	360,000.00	0.25
123	000157	中联重科	50,000	358,500.00	0.25
124	000786	北新建材	10,000	358,300.00	0.25
125	603259	药明康德	3,000	355,740.00	0.25
126	000661	长春高新	1,300	352,820.00	0.25
127	300121	阳谷华泰	30,000	348,300.00	0.25
128	600522	中天科技	20,000	339,200.00	0.24
129	603799	华友钴业	3,000	330,930.00	0.23
130	601901	方正证券	41,800	327,712.00	0.23
131	000963	华东医药	8,000	321,600.00	0.23
132	000876	新希望	20,800	316,368.00	0.22
133	002314	南山控股	100,000	312,000.00	0.22
134	300003	乐普医疗	13,700	310,031.00	0.22
135	002368	太极股份	11,060	304,592.40	0.21
136	000636	风华高科	10,000	298,000.00	0.21
136	601138	工业富联	25,000	298,000.00	0.21
137	000425	徐工机械	49,100	294,109.00	0.21
138	000596	古井贡酒	1,200	292,800.00	0.21
139	000069	华侨城 A	41,500	292,160.00	0.21
140	300451	创业慧康	26,000	290,680.00	0.20

141	002157	正邦科技	30,000	289,800.00	0.20
142	300033	同花顺	2,000	289,160.00	0.20
143	000783	长江证券	38,300	288,782.00	0.20
144	600029	南方航空	42,000	286,020.00	0.20
145	300015	爱尔眼科	6,612	279,555.36	0.20
146	000895	双汇发展	8,800	277,640.00	0.20
147	002294	信立泰	10,000	273,200.00	0.19
148	002007	华兰生物	9,300	271,002.00	0.19
149	601800	中国交建	29,400	252,252.00	0.18
150	002351	漫步者	20,000	234,400.00	0.17
151	000789	万年青	18,900	230,958.00	0.16
152	002555	三七互娱	8,300	224,266.00	0.16
153	002508	老板电器	6,168	222,171.36	0.16
154	002100	天康生物	20,000	214,000.00	0.15
155	000723	美锦能源	12,800	207,744.00	0.15
156	000728	国元证券	26,650	205,205.00	0.14
157	300433	蓝思科技	8,600	197,628.00	0.14
158	002531	天顺风能	10,000	193,900.00	0.14
159	002120	韵达股份	9,400	192,324.00	0.14
160	688075	安旭生物	1,421	182,982.17	0.13
161	002044	美年健康	22,960	180,236.00	0.13
162	002916	深南电路	1,400	170,548.00	0.12
163	300136	信维通信	6,700	169,644.00	0.12
164	000703	恒逸石化	15,700	166,734.00	0.12
165	002422	科伦药业	8,800	166,584.00	0.12
166	603019	中科曙光	6,000	165,420.00	0.12
167	600183	生益科技	7,000	164,850.00	0.12
168	002024	苏宁易购	38,500	158,620.00	0.11
169	002739	万达电影	10,000	154,800.00	0.11
170	603160	汇顶科技	1,400	150,878.00	0.11
171	002798	帝欧家居	10,000	148,700.00	0.10
172	600867	通化东宝	13,500	147,960.00	0.10
173	002252	上海莱士	20,200	137,764.00	0.10
174	600547	山东黄金	7,140	134,374.80	0.09
175	300017	网宿科技	20,000	133,800.00	0.09
176	600498	烽火通信	7,300	131,254.00	0.09
177	600606	绿地控股	27,300	118,482.00	0.08
178	601066	中信建投	4,000	117,000.00	0.08
179	000709	河钢股份	43,300	106,518.00	0.08

180	002938	鹏鼎控股	2,400	101,832.00	0.07
181	002032	苏泊尔	1,600	99,584.00	0.07
182	000656	金科股份	21,200	94,976.00	0.07
183	601319	中国人保	18,300	86,010.00	0.06
184	688161	威高骨科	1,337	85,193.64	0.06
185	300497	富祥药业	4,800	78,384.00	0.06
186	002146	荣盛发展	17,500	76,125.00	0.05
187	688230	芯导科技	518	74,022.20	0.05
188	002558	巨人网络	6,000	71,820.00	0.05
189	000961	中南建设	17,100	70,794.00	0.05
190	000627	天茂集团	19,300	63,883.00	0.05
191	002607	中公教育	7,400	58,164.00	0.04
192	002841	视源股份	700	56,980.00	0.04
193	002707	众信旅游	10,000	56,400.00	0.04
194	000671	阳光城	17,500	52,850.00	0.04
195	688737	中自科技	902	49,664.12	0.04
196	002939	长城证券	3,500	45,325.00	0.03
197	002773	康弘药业	2,100	42,735.00	0.03
198	301029	怡合达	462	41,519.94	0.03
199	301189	奥尼电子	627	37,418.34	0.03
200	600089	特变电工	1,700	35,989.00	0.03
201	688265	南模生物	475	33,273.75	0.02
202	002468	申通快递	3,500	31,815.00	0.02
203	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.02
204	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.02
205	601236	红塔证券	2,100	25,032.00	0.02
206	301058	中粮工科	1,361	24,824.64	0.02
207	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.02
208	002958	青农商行	5,800	22,388.00	0.02
209	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
210	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
211	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
212	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
213	301155	海力风电	153	14,802.75	0.01
214	301035	润丰股份	258	14,520.24	0.01
215	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
216	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.01
217	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
218	601233	桐昆股份	640	13,555.20	0.01

219	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
220	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
221	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
222	301009	可靠股份	677	12,490.65	0.01
223	300996	普联软件	385	12,162.15	0.01
224	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
225	301185	鸥玛软件	565	11,955.40	0.01
226	301188	力诺特玻	583	11,939.84	0.01
227	600011	华能国际	1,200	11,628.00	0.01
228	301039	中集车辆	929	11,621.79	0.01
229	601600	中国铝业	1,900	11,571.00	0.01
230	600886	国投电力	1,000	11,470.00	0.01
231	301118	恒光股份	231	11,323.62	0.01
232	601225	陕西煤业	900	10,980.00	0.01
233	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.01
234	301011	华立科技	175	10,535.00	0.01
235	301048	金鹰重工	771	9,992.16	0.01
236	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.01
237	301087	可孚医疗	131	9,869.54	0.01
238	301090	华润材料	852	9,559.44	0.01
239	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.01
240	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.01
241	301078	孩子王	756	9,177.84	0.01
242	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
243	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.01
244	600741	华域汽车	300	8,490.00	0.01
245	301025	读客文化	403	8,414.64	0.01
246	301127	天源环保	477	8,166.24	0.01
247	300814	中富电路	328	7,832.64	0.01
248	301177	迪阿股份	66	7,661.28	0.01
249	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.01
250	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.01
251	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
252	301211	亨迪药业	208	6,999.20	0.00
253	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
254	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
255	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
256	600153	建发股份	700	6,349.00	0.00
257	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00

258	301198	喜悦智行	216	6,307.20	0.00
259	301101	明月镜片	145	6,287.20	0.00
260	600115	中国东航	1,200	6,192.00	0.00
261	301138	华研精机	137	6,145.82	0.00
262	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
263	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
264	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
265	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
266	601607	上海医药	300	5,961.00	0.00
267	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
268	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
269	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
270	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
271	301221	光庭信息	60	5,323.20	0.00
272	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
273	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
274	301093	华兰股份	103	5,134.55	0.00
275	301049	超越科技	152	5,003.84	0.00
276	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
277	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
278	301092	争光股份	138	4,901.76	0.00
279	301199	迈赫股份	150	4,800.00	0.00
280	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
281	600643	爱建集团	700	4,732.00	0.00
282	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
283	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
284	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
285	601727	上海电气	900	4,374.00	0.00
286	301168	通灵股份	82	4,274.66	0.00
287	301100	风光股份	135	4,203.90	0.00
288	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
289	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
290	301182	凯旺科技	130	3,975.40	0.00
291	601333	广深铁路	1,700	3,808.00	0.00
292	301108	洁雅股份	70	3,759.70	0.00
293	301190	善水科技	132	3,624.72	0.00
294	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
295	301179	泽宇智能	66	3,350.82	0.00
296	301096	百诚医药	38	2,984.14	0.00

297	600352	浙江龙盛	200	2,526.00	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	7,483,300.00	2.88
2	601939	建设银行	5,224,200.00	2.01
3	600216	浙江医药	3,781,946.00	1.45
4	600872	中炬高新	3,521,004.00	1.35
5	600048	保利发展	3,434,500.00	1.32
6	300567	精测电子	3,326,700.00	1.28
7	601009	南京银行	2,803,800.00	1.08
8	000858	五粮液	2,644,555.00	1.02
9	002385	大北农	2,334,700.00	0.90
10	601108	财通证券	2,311,000.00	0.89
11	000776	广发证券	2,236,679.00	0.86
12	000603	盛达资源	2,071,000.00	0.80
13	603533	掌阅科技	1,807,901.50	0.70
14	002460	赣锋锂业	1,747,767.00	0.67
15	000012	南玻 A	1,704,170.00	0.66
16	600966	博汇纸业	1,601,820.00	0.62
17	601139	深圳燃气	1,579,800.00	0.61
18	002074	国轩高科	1,550,400.00	0.60
19	300408	三环集团	1,494,300.00	0.57
20	600176	中国巨石	1,421,800.00	0.55

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,405,686.00	3.62
2	600030	中信证券	5,574,516.00	2.14
3	601939	建设银行	4,126,652.00	1.59

4	600216	浙江医药	4,086,517.48	1.57
5	601318	中国平安	3,889,115.79	1.50
6	600872	中炬高新	3,618,790.00	1.39
7	000333	美的集团	3,454,224.60	1.33
8	600048	保利发展	3,432,884.00	1.32
9	600036	招商银行	3,429,047.00	1.32
10	601166	兴业银行	3,403,412.00	1.31
11	601009	南京银行	2,935,410.50	1.13
12	000568	泸州老窖	2,628,453.29	1.01
13	002920	德赛西威	2,289,000.00	0.88
14	300408	三环集团	2,216,008.56	0.85
15	300567	精测电子	2,207,200.00	0.85
16	601328	交通银行	2,161,436.00	0.83
17	000776	广发证券	2,129,670.00	0.82
18	600966	博汇纸业	1,914,462.00	0.74
19	600309	万华化学	1,838,320.00	0.71
20	601398	工商银行	1,798,155.00	0.69

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	128,258,260.91
卖出股票收入（成交）总额	191,247,682.16

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 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持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，兴业银行（601166）的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）存在被监管公开处罚的情形。

#### 1、兴业银行（601166）

根据 2021 年 8 月 13 日的行政处罚决定，因兴业银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行罚款 5 万元。

对兴业银行的投资决策程序的说明：

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对上述机构的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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	69,314.36
2	应收证券清算款	131,105.15
3	应收股利	-
4	应收利息	1,017.43
5	应收申购款	2,901.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	204,337.96

**8.12.4 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。

**8.12.5 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未存在流通受限的情况。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
诺德量化蓝筹 A	441	205.60	-	-	90,669.93	100.00%
诺德量化蓝筹 C	911	130,510.86	117,429,898.29	98.77%	1,465,499.14	1.23%
合计	1,352	88,007.45	117,429,898.29	98.69%	1,556,169.07	1.31%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金份额。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	诺德量化蓝筹 A	0
	诺德量化蓝筹 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺德量化蓝筹 A	0
	诺德量化蓝筹 C	0
	合计	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）基金份额总额	10,754,678.64	195,065,602.49
本报告期期初基金份额总额	21,902,259.14	214,196,241.77
本报告期基金总申购份额	18,553,329.65	364,238,047.29
减:本报告期基金总赎回份额	40,364,918.86	459,538,891.63
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	90,669.93	118,895,397.43

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额包含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本基金管理人 2021 年 7 月 27 日发布公告，梁明亮先生、冯奕先生自 2021 年 7 月 26 日起担任公司副总经理。

本基金管理人 2021 年 9 月 17 日发布公告，尚栋良先生自 2021 年 9 月 16 日起担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

(2) 2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2021 年度的基金审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的报酬人民币 6 万元。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 5 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	

财信证券	2	264,994,129.33	86.04%	246,789.01	86.04%	-
光大证券	2	43,008,660.33	13.96%	40,053.90	13.96%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家证券公司租用了基金交易单元。

#### 1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全、在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

#### 2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
财信证券	-	-	201,000,000.00	93.06%	-	-
光大证券	-	-	15,000,000.00	6.94%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
2	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
3	诺德基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司	四大报、指定互联网网站	2021 年 2 月 8 日

	办理本公司旗下基金销售业务的公告		
4	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 10 日
5	关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021 年 3 月 23 日
6	诺德基金管理有限公司关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021 年 3 月 26 日
7	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2020 年年度报告	指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日
8	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日
9	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
10	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
11	诺德基金管理有限公司关于调整微信网上直销业务优惠费率率的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
12	诺德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 24 日
13	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国人寿保险股份有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 18 日
14	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富（上海）基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 29 日
15	关于诺德量化蓝筹增强混合	中国证券报、指定互	2021 年 6 月 18 日

	型证券投资基金恢复大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	联网网站	
16	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京虹点基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年6月19日
17	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京度小满基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年6月22日
18	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海爱建基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年6月22日
19	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司申购(含定期定额投资)、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年7月2日
20	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司申购(含定期定额投资)、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年7月6日
21	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海钜派钰茂基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年7月14日
22	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	指定互联网网站	2021年7月21日
23	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021年7月21日
24	诺德基金管理有限公司基金	四大报、指定互联网	2021年7月27日

	行业高级管理人员变更公告	网站	
25	诺德基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 7 月 27 日
26	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司申购(含定期定额投资)业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 7 月 31 日
27	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京新浪仓石基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、指定互联网网站	2021 年 8 月 13 日
28	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金销售(深圳)有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 8 月 20 日
29	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年中期报告	指定互联网网站	2021 年 8 月 28 日
30	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 8 月 28 日
31	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在众惠基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 8 月 31 日
32	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富基金销售有限公司开通申购(含定期定额投资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 9 月 10 日
33	诺德基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 9 月 17 日
34	诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 9 月 30 日
35	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定互联网网站	2021 年 9 月 30 日

36	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年9月）	指定互联网网站	2021年9月30日
37	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	指定互联网网站	2021年10月27日
38	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021年10月27日
39	诺德基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	四大报、指定互联网网站	2021年11月16日
40	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在阳光人寿保险股份有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年11月18日
41	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年11月20日
42	诺德基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	四大报、指定互联网网站	2021年11月26日
43	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券股份有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年12月17日

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101 - 20210224	67,425,180.05	-	67,425,180.05	0.00	0.00%
	2	20210225 - 20210405; 20211124 - 20211212	-	67,743,616.47	45,170,000.00	22,573,616.47	18.97%
	3	20210311 - 20210530	32,697,547.68	18,225,644.76	50,923,192.44	0.00	0.00%
	4	20210408 - 20210412; 20210416 - 20210419; 20210602 - 20210620; 20210702 - 20210704; 20210709 - 20210712	38,395,276.51	-	38,395,276.51	0.00	0.00%
	5	20211124 - 20211231	-	27,322,404.37	-	27,322,404.37	22.96%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

##### 2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

##### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年年度报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

### 13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：[www.nuodefund.com](http://www.nuodefund.com)。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人诺德基金管理有限公司，咨询电话 400-888-0009、(021)68604888，或发电子邮件，E-mail:service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日