

诺安价值增长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

报告送出日期：2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	46
8.1	期末基金资产组合情况	46
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12	投资组合报告附注	54
§ 9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 10	开放式基金份额变动	55
§ 11	重大事件揭示	56
11.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4	基金投资策略的改变	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8	其他重大事件	58
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 13	备查文件目录	62
13.1	备查文件目录	62
13.2	存放地点	63
13.3	查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安价值增长混合型证券投资基金
基金简称	诺安价值增长混合
基金主代码	320005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月21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	668,919,808.99份
基金合同存续期	不定期

注：自2015年8月6日起，原“诺安价值增长股票证券投资基金”变更为“诺安价值增长混合型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国GDP的高速增长和资本市场的快速增长,发掘价值低估和能够长期持续增长的优秀企业,获得稳定的中长期资本投资收益。
投资策略	在资产配置方面,根据国内外宏观经济形势、资本和货币市场的走势,采取自上而下的方法,合理调整基金资产中股票投资的比例,并附之以适当的债券和现金投资;在股票选择方面,采取自下而上的方法精选股票;在存托凭证投资方面,根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资;在债券选择方面,通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线,积极调整债券组合的久期结构,运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中证全债指数收益率
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2018年1月22日起，本基金业绩比较基准由“80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数”变更为“沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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	李学君	郭明
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.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 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李强	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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	282,498,847.59	276,371,320.76	20,701,115.92
本期利润	158,751,172.65	600,638,758.67	427,150,927.55
加权平均基金份额本期利润	0.2174	0.5777	0.3176
本期加权平均净值利润率	11.78%	40.28%	28.02%
本期基金份额净值增长率	12.07%	48.93%	35.84%
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	675,747,307.41	566,336,881.02	279,715,799.61
期末可供分配基金份额利润	1.0102	0.6692	0.2044
期末基金资产净值	1,344,667,116.40	1,518,108,235.70	1,647,940,952.34
期末基金份额净值	2.0102	1.7937	1.2044
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	307.82%	263.89%	144.34%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费

用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	9.08%	1.03%	1.52%	0.63%	7.56%	0.40%
过去六个月	5.49%	1.26%	-3.65%	0.82%	9.14%	0.44%
过去一年	12.07%	1.52%	-2.86%	0.94%	14.93%	0.58%
过去三年	126.73%	1.45%	54.18%	1.03%	72.55%	0.42%
过去五年	73.49%	1.36%	40.68%	0.96%	32.81%	0.40%
自基金合同生效起至今	307.82%	1.51%	189.49%	1.36%	118.33%	0.15%

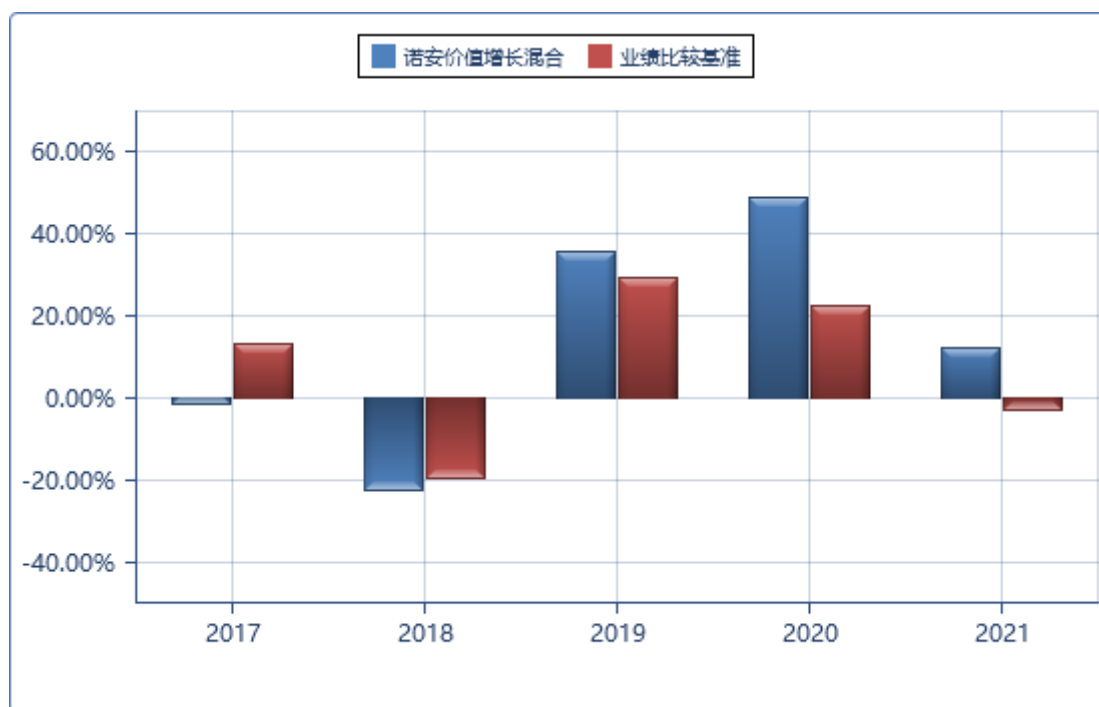
注：本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

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



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 62 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证

券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王创练	本基金基金经理	2019年01月22日	-	25年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于特区证券研究所、南方证券研究所、长城基金管理有限公司等，2008年3月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部副总监、研究部总经理，现任首席策略师（总助级）。2017年3月至2018年6月任诺安平衡证券投资基金基金经理，2018年6月至2020年5月任诺安成长混合型证券投资基金基金经理。2015年3月起任诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理，2018

					年3月起任诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任诺安价值增长混合型证券投资基金基金经理，2020年5月起任诺安研究优选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，诺安价值增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《诺安价值增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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年受信用紧缩、疫情反复、产业政策调整等因素影响，经济冲高回落。新冠疫情对各产业影响差异显著，部分产业链供需关系阶段性失衡，叠加耗能双控政策导致的供给收缩，产业链中下游环节成本压力显著提高。本基金阶段性地把握了上游原材料及大宗上涨的机会。

上半年我国由于疫情控制得当，出口份额快速提升，宏观杠杆率得到释放，在原油价格上涨的背景下，上游大宗价格上涨带动了周期行业的行情；下半年起，国内经济下行压力加大，在“能耗双控”的背景下，原材料被推高，中游制造业同时面临需求下滑、成本上涨的压力，而难以转嫁的中小企业在这轮周期中受抑制较为明显。与此同时，疫情的局部反复更是对居民消费构成直接影响，进而对消费板块造成了直接冲击。

市场风格正在发生变化，但我们相信股价最终还是将回归其内在价值，那么寻找有长期价值的核心标的仍旧是我们努力的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为2.0102元，本报告期内基金份额净值增长率为12.07%，同期业绩比较基准收益率为-2.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

迈入 2022 年，A 股市场出现了一定的调整，是内外交互影响的结果。从外部看，美联储货币政策急剧转弯，尤其是 1 月过于鹰派的表述引发全球权益市场调整，同时叠加局部地缘政治的不稳定因素发酵；而内部在中央经济会议稳增长目标确定后，从政策酝酿出台到经济回暖仍需传导时间，也在一定程度上加剧了市场的担忧。

展望 2022 年的投资机会，企业盈利在经济的大背景下逐季下行是确定性较高的变量。这之中既有前一年的基数因素，同时也与疫情防控常态化以及地产行业骤变相关，此二者在一定程度上使得短期经济增长动能略显缺乏。此外，在我们面前的全球大环境较此前任何时候都更加复杂和严峻，对此我们需要有一定的预期。

2021 年 12 月中央经济会议强调“坚持以经济建设为中心是党的基本路线的要求”，我们也认为中国经济和企业本身蕴含着巨大的潜力，那么现阶段经济下行的压力只是暂时的，坚信中国经济长期前景依然光明。

截止壬寅农历年前，绝大部分省已召开两会并陆续公布经济目标与工作重点。超八成的省份所定的 GDP 目标增速高于 2021 年两年平均增速，凸显地方政府稳增长的决心，而落实到扩大内需的抓手，相较于消费和出口，主要仍在投资。大部分省份在基建领域部署了重点项目，发力姿态明确，其中交运、电力、水利和市政项目比例较高。各地方也出台了促消费的政策，主要集中在提振新能源车消费和家电下乡。

在这种背景下，我们认为有一批优质的公司仍能为社会和客户创造价值，提升全社会的生产效率。因此，站在长期的维度上，高端制造和消费双升级的背景下，我们有理由相信 A 股中长期的投资价值正不断凸显。

为越来越多投资人带来持续的复利增长是我们管理人的职业情愫和职业追求，为此我们必谨慎独行、业精于勤，以此表达投资人对我们的信任和委托的衷心感谢。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在内部监察工作中，本着合法合规运作、最大限度保障基金份额持有人利益的宗旨，本基金管理人建立并完善了以合规、监察、稽核为主导的工作体系和流程。合规管理部门依照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，严格按照监察稽核工作计划、方法和程序开展工作，确保了公司勤勉尽责地管理基金资产。

本年度基金管理人合规管理、内部风险控制、监察稽核的具体情况如下：

合规管理方面，基金管理人积极开展法律法规的宣导及培训，督促各业务部门落实监管要求，持

续完善公司内部制度建设，防范各类合规风险。风险控制方面，基金管理人 对基金的日常投资运作进行持续的监督管理，加强基金流动性风险管理，确保基金资产的合规运作。监察稽核方面，根据中国证监会和公司内部控制制度的要求，基金管理人在报告期内通过定期稽核和专项稽核等方式对公司内部控制制度、业务操作流程、基金销售、宣传推介、投资运作、后台保障、反洗钱等公司业务环节和工作岗位进行了重点监控与稽核。对于每次监察稽核工作中发现的问题，都责成各相关部门认真总结、提出整改意见和措施，切实进行改善，并由合规管理部门跟踪问题的处理情况。同时，基金管理人督促市场部门利用各种机会，通过多种渠道，以形式多样的方式，做好投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，无内幕交易和不正当关联交易，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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 90%；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23034 号

6.2 审计报告的基本内容

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

	<p>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，就可能对诺安价值增长混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺安价值增长混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞, 肖菊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺安价值增长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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	102,947,345.58	161,948,605.13
结算备付金		470,160.17	1,010,836.02

存出保证金		120,462.43	155,767.77
交易性金融资产	7.4.7.2	1,246,022,401.07	1,375,362,906.53
其中：股票投资		1,246,022,401.07	1,375,362,906.53
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		-	627,713.75
应收利息	7.4.7.5	9,723.65	14,001.81
应收股利		-	-
应收申购款		41,130.65	94,079.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,349,611,223.55	1,539,213,910.02
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2021年12月31日	2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,183,461.19	9,985,438.00
应付赎回款		884,324.32	7,761,954.56
应付管理人报酬		1,707,540.98	1,840,985.87
应付托管费		284,590.17	306,830.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	240,343.75	563,479.61
应交税费		419,101.00	419,101.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	224,745.74	227,884.31
负债合计		4,944,107.15	21,105,674.32
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	668,919,808.99	846,350,583.70
未分配利润	7.4.7.10	675,747,307.41	671,757,652.00
所有者权益合计		1,344,667,116.40	1,518,108,235.70
负债和所有者权益总计		1,349,611,223.55	1,539,213,910.02

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值2.0102元，基金份额总额668,919,808.99份。

7.2 利润表

会计主体：诺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01 日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31 日
一、收入		186,319,974.01	632,999,633.94
1. 利息收入		460,526.99	746,557.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	460,526.99	675,450.99
债券利息收入		-	2,719.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	68,386.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		309,498,592.26	307,349,475.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	296,091,212.97	294,887,176.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	1,115,607.83
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	13,407,379.29	11,346,691.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-123,747,674.94	324,267,437.91
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	108,529.70	636,163.40
减：二、费用		27,568,801.36	32,360,875.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,261,584.89	22,378,548.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,376,930.85	3,729,758.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,685,359.62	6,014,091.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	9.79
7. 其他费用	7.4.7.20	244,926.00	238,467.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		158,751,172.65	600,638,758.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		158,751,172.65	600,638,758.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01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）	846,350,583. 70	671,757,652 .00	1,518,108, 235.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	158,751,172 .65	158,751,17 2.65
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）	-177,430,774 .71	-154,761,51 7.24	-332,192,2 91.95
其中：1. 基金申购款	28,252,621.4 2	24,537,677. 20	52,790,298 .62
2. 基金赎回款	-205,683,396 .13	-179,299,19 4.44	-384,982,5 90.57
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）	668,919,808. 99	675,747,307 .41	1,344,667, 116.40
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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）	1,368,225,15 2.73	279,715,799 .61	1,647,940, 952.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	600,638,758 .67	600,638,75 8.67
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）	-521,874,569 .03	-208,596,90 6.28	-730,471,4 75.31
其中：1. 基金申购款	144,380,357. 70	56,058,804. 28	200,439,16 1.98
2. 基金赎回款	-666,254,926 .73	-264,655,71 0.56	-930,910,6 37.29
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）	846,350,583. 70	671,757,652 .00	1,518,108, 235.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

齐斌

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安价值增长混合型证券投资基金(原名为“诺安价值增长股票证券投资基金”,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”)证监基金字(2006)209号《关于同意诺安价值增长股票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《诺安价值增长股票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5,957,953,112.84元。经向中国证监会备案,《诺安价值增长股票证券投资基金基金合同》于2006年11月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,959,233,262.60份基金份额,其中认购资金利息折合1,280,149.76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》,诺安价值增长股票证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为诺安价值增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《诺安价值增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、存托凭证、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。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债,权证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、存托凭证资产的比例为60-95%,债券资产的比例为0-35%,持有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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 80%+中证全债指数收益率 \times 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安价值增长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。

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、存托凭证、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a)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90%，若《诺安价值增长股票证券投资基金基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(b)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c)本基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(d)本基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(e)本基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(f)每一基金份额享有同等分配权；

(g)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应

纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	102,947,345.58	161,948,605.13
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	102,947,345.58	161,948,605.13

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	825,735,305.81	1,246,022,401.07	420,287,095.26
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	825,735,305.81	1,246,022,401.07	420,287,095.26
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	831,328,136.33	1,375,362,906.53	544,034,770.20
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	831,328,136.33	1,375,362,906.53	544,034,770.20

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	9,457.95	13,476.81
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	211.50	454.90
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	54.20	70.10
合计	9,723.65	14,001.81

注：此处“其他”列示的是应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 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	240,343.75	563,479.61
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	240,343.75	563,479.61

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	245.74	7,884.31
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	224,500.00	220,000.00
合计	224,745.74	227,884.31

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	846,350,583.70	846,350,583.70
本期申购	28,252,621.42	28,252,621.42
本期赎回（以“-”号填列）	-205,683,396.13	-205,683,396.13
本期末	668,919,808.99	668,919,808.99

注：此处申购含红利再投资、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	566,336,881.02	105,420,770.98	671,757,652.00
本期利润	282,498,847.59	-123,747,674.94	158,751,172.65
本期基金份额交易产生的变动数	-150,499,514.51	-4,262,002.73	-154,761,517.24
其中：基金申购款	24,665,185.57	-127,508.37	24,537,677.20
基金赎回款	-175,164,700.08	-4,134,494.36	-179,299,194.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	698,336,214.10	-22,588,906.69	675,747,307.41

7.4.7.11 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	442,652.95	643,875.52
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	15,048.04	27,640.23
其他	2,826.00	3,935.24
合计	460,526.99	675,450.99

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,455,536,719.60	2,285,419,544.39
减：卖出股票成本总额	1,159,445,506.63	1,990,532,368.30
买卖股票差价收入	296,091,212.97	294,887,176.09

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	15,642,363.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	14,523,700.00
减：应收利息总额	-	3,055.95
买卖债券差价收入	-	1,115,607.83

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,407,379.29	11,346,691.43
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	13,407,379.29	11,346,691.43

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-123,747,674.94	324,267,437.91
--股票投资	-123,747,674.94	324,267,437.91
--债券投资	-	-
--资产支持证券投资	-	-
--基金投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
--权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-123,747,674.94	324,267,437.91

7.4.7.18 其他收入

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12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	81,811.18	541,283.46
基金转换费收入	26,718.52	94,565.43
其他	-	314.51

合计	108,529.70	636,163.40
----	------------	------------

注：上年度“其他”为蚂蚁集团退款中由新股认购资金及新股配售经纪佣金产生的利息返还。

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01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,685,359.62	6,014,091.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,685,359.62	6,014,091.96

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	426.00	467.00
律师费	2,000.00	-
账户维护费	22,500.00	18,000.00
合计	244,926.00	238,467.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市捷隆投资有限公司	基金管理人的股东
大恒新纪元科技股份有限公司	基金管理人的股东
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司
诺安国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,261,584.89	22,378,548.41
其中：支付销售机构的客户维护费	3,592,810.35	3,893,594.41

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为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,376,930.85	3,729,758.11

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 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	102,947,345.58	442,652.95	161,948,605.13	643,875.52

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末 2021 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

		日	日							
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年07月12日	2022年01月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年07月14日	2022年01月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年07月15日	2022年01月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年07月21日	2022年01月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年07月01日	2022年01月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021年07月26日	2022年02月07日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年08月06日	2022年02月17日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-

301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年08月11日	2022年02月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年08月17日	2022年02月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年08月26日	2022年03月07日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301059	金三江	2021年09月03日	2022年03月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年09月06日	2022年03月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年09月07日	2022年03月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年09月13日	2022年03月22日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年09月16日	2022年03月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年09月22日	2022年03月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301077	君亭	2021年	2022年	新股锁	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-

3	酒店	09月22日	03月30日	定						
301078	孩子王	2021年09月30日	2022年04月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年04月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年04月28日	新股锁定	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年04月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年04月26日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年06月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年05月12日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年05月23日	新股锁定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年06月06日	新股锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月09日	2022年05月18日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-

		日	日							
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年06月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月08日	2022年06月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月03日	2022年05月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年05月24日	新股锁定	60.66	96.75	1,030	62,479.80	99,652.50	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年06月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021年12月02日	2022年06月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301179	泽宇智能	2021年12月01日	2022年06月08日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年11月09日	2022年05月16日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年06月23日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年05月19日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301193	家联科技	2021年12月02日	2022年06月09日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年06月02日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年06月07日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年06月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年01月05日	新股未上市	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-
601728	中国电信	2021年08月11日	2022年02月21日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
601872	招商轮船	2020年01月10日	2022年01月10日	非公开发行锁定	4.47	4.07	1,119,403	5,000,000.96	4,555,970.21	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年07月05日	新股锁定	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-
688071	华依科技	2021年07月21日	2022年02月07日	新股锁定	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688151	华强科技	2021年11月29日	2022年06月06日	新股锁定	35.09	33.82	12,238	429,431.42	413,889.16	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688789	宏华数科	2021年07月01日	2022年01月10日	新股锁定	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-

注：1、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。

2、上述流通受限证券的可流通日期以上市公司公告为准。

3、本基金持有的流通受限股票“601872 招商轮船”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.2 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人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 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于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司

可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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。

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	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	102,947,345.58	-	-	-	-	102,947,345.58
结算备付金	470,160.17	-	-	-	-	470,160.17
存出保证金	120,462.43	-	-	-	-	120,462.43
交易性金融资产	-	-	-	-	1,246,022,401.07	1,246,022,401.07
应收利息	-	-	-	-	9,723.65	9,723.65
应收申购款	-	-	-	-	41,130.65	41,130.65
资产总计	103,537,968.18	-	-	-	1,246,073,255.37	1,349,611,223.55
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,183,461.19	1,183,461.19
应付赎回款	-	-	-	-	884,324.32	884,324.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,707,540.98	1,707,540.98
应付托管费	-	-	-	-	284,590.17	284,590.17
应付交易费用	-	-	-	-	240,343.75	240,343.75
应交税费	-	-	-	-	419,101.00	419,101.00
其他负债	-	-	-	-	224,745.74	224,745.74
负债总计	-	-	-	-	4,944,107.15	4,944,107.15
利率敏感度缺口	103,537,968.18	-	-	-	-1,241,129,148.22	1,344,667,116.40
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	161,948,605.13	-	-	-	-	161,948,605.13
结算备付金	1,010,836.02	-	-	-	-	1,010,836.02
存出保证金	155,767.77	-	-	-	-	155,767.77
交易性金融资产	-	-	-	-	1,375,362,906.53	1,375,362,906.53
应收证券清算款	-	-	-	-	627,713.75	627,713.75
应收利息	-	-	-	-	14,001.81	14,001.81
应收申购款	300.00	-	-	-	93,779.01	94,079.01
资产总计	163,115,508.92	-	-	-	1,376,098,401.10	1,539,213,910.02
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	9,985,438.00	9,985,438.00
应付赎回款	-	-	-	-	7,761,954.56	7,761,954.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,840,985.87	1,840,985.87
应付托管费	-	-	-	-	306,830.97	306,830.97
应付交易费用	-	-	-	-	563,479.61	563,479.61

应交税费	-	-	-	-	419,101.00	419,101.00
其他负债	-	-	-	-	227,884.31	227,884.31
负债总计	-	-	-	-	21,105,674.32	21,105,674.32
利率敏感度缺口	163,115,508.92	-	-	-	-1,354,992,726.78	1,518,108,235.70

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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、存托凭证资产的比例为60-95%，债券投资的比例为0-35%，持有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%。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	公允价值	占基金资产净

		比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,246,022,401.07	92.66	1,375,362,906.53	90.60
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	1,246,022,401.07	92.66	1,375,362,906.53	90.60

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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)
	业绩比较基准上升5%	70,527,599.92	76,212,612.95
	业绩比较基准下降5%	-70,527,599.92	-76,212,612.95

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,230,391,132.28元，属于第二层次的余额为15,631,268.79元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次1,358,763,813.23元，第二层次16,599,093.30元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

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

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,246,022,401.07	92.32
	其中：股票	1,246,022,401.07	92.32
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	103,417,505.75	7.66
8	其他各项资产	171,316.73	0.01
9	合计	1,349,611,223.55	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,124,611.00	1.94
C	制造业	984,346,262.65	73.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	512,988.00	0.04
E	建筑业	1,225,135.99	0.09
F	批发和零售业	5,677,437.56	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	13,372,570.54	0.99
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	103,755,543.53	7.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	105,000,258.91	7.81
M	科学研究和技术服务业	287,458.48	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	5,659,432.32	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,246,022,401.07	92.66

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601058	赛轮轮胎	8,618,905	127,473,604.95	9.48
2	600809	山西汾酒	334,613	105,664,093.14	7.86
3	002475	立讯精密	1,948,558	95,869,053.60	7.13
4	002605	姚记科技	3,907,149	88,809,496.77	6.60
5	000568	泸州老窖	332,095	84,308,957.65	6.27
6	603369	今世缘	1,519,248	82,647,091.20	6.15
7	600057	厦门象屿	9,499,759	80,652,953.91	6.00
8	000858	五粮液	256,569	57,127,653.54	4.25
9	601677	明泰铝业	1,075,444	47,416,325.96	3.53
10	002810	山东赫达	566,591	34,885,007.87	2.59
11	603589	口子窖	393,498	27,887,203.26	2.07
12	002353	杰瑞股份	655,200	26,208,000.00	1.95
13	300725	药石科技	168,720	23,986,922.40	1.78
14	300088	长信科技	1,792,600	23,805,728.00	1.77
15	300772	运达股份	526,793	23,168,356.14	1.72
16	002304	洋河股份	117,500	19,355,775.00	1.44
17	600779	水井坊	161,300	19,354,387.00	1.44
18	601888	中国中免	81,200	17,816,092.00	1.32
19	601615	明阳智能	586,000	15,294,600.00	1.14
20	603801	志邦家居	499,608	15,198,075.36	1.13
21	300685	艾德生物	200,089	15,108,720.39	1.12
22	000422	湖北宣化	620,033	13,212,903.23	0.98
23	600256	广汇能源	1,934,500	12,651,630.00	0.94
24	002080	中材科技	360,030	12,248,220.60	0.91
25	002648	卫星化学	285,900	11,444,577.00	0.85
26	002484	江海股份	401,100	10,958,052.00	0.81
27	601898	中煤能源	1,656,300	10,418,127.00	0.77
28	300014	亿纬锂能	77,500	9,158,950.00	0.68
29	600519	贵州茅台	4,400	9,020,000.00	0.67
30	603565	中谷物流	309,647	8,790,878.33	0.65
31	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.53
32	600563	法拉电子	29,000	6,739,600.00	0.50
33	600745	闻泰科技	49,700	6,426,210.00	0.48
34	300363	博腾股份	70,000	6,261,500.00	0.47
35	603799	华友钴业	51,600	5,691,996.00	0.42
36	002266	浙富控股	784,300	5,584,216.00	0.42
37	000596	古井贡酒	21,900	5,343,600.00	0.40
38	002545	东方铁塔	568,400	5,183,808.00	0.39
39	002129	中环股份	120,500	5,030,875.00	0.37

40	603218	日月股份	145,000	4,777,750.00	0.36
41	601872	招商轮船	1,119,403	4,555,970.21	0.34
42	300280	紫天科技	131,500	4,359,225.00	0.32
43	605266	健之佳	53,430	4,091,135.10	0.30
44	002724	海洋王	243,700	3,984,495.00	0.30
45	688625	呈和科技	63,932	3,588,503.16	0.27
46	600887	伊利股份	86,400	3,582,144.00	0.27
47	605358	立昂微	29,500	3,540,295.00	0.26
48	300773	拉卡拉	121,700	3,531,734.00	0.26
49	600395	盘江股份	420,200	3,054,854.00	0.23
50	002027	分众传媒	265,200	2,171,988.00	0.16
51	688235	百济神州	14,413	2,082,822.63	0.15
52	300861	美畅股份	23,900	1,858,703.00	0.14
53	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.13
54	688521	芯原股份	20,875	1,614,890.00	0.12
55	300910	瑞丰新材	19,900	1,589,015.00	0.12
56	300821	东岳硅材	74,300	1,358,204.00	0.10
57	601669	中国电建	150,200	1,213,616.00	0.09
58	601865	福莱特	20,800	1,205,152.00	0.09
59	000906	浙商中拓	106,600	1,184,326.00	0.09
60	688032	禾迈股份	1,146	806,772.54	0.06
61	300777	中简科技	8,400	519,792.00	0.04
62	600863	内蒙华电	130,200	512,988.00	0.04
63	688112	鼎阳科技	4,901	480,199.98	0.04
64	688151	华强科技	12,238	413,889.16	0.03
65	301035	润丰股份	6,438	372,296.32	0.03
66	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.03
67	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
68	688690	纳微科技	3,477	277,534.14	0.02
69	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.02
70	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.02
71	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.01
72	688286	敏芯股份	1,681	155,828.70	0.01
73	688079	美迪凯	10,622	155,824.74	0.01
74	688682	霍莱沃	946	154,179.08	0.01
75	688661	和林微纳	1,452	146,013.12	0.01
76	688613	奥精医疗	2,617	144,615.42	0.01
77	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
78	688560	明冠新材	3,832	132,548.88	0.01
79	688609	九联科技	10,372	130,894.64	0.01
80	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.01

81	301155	海力风电	1,030	99,652.50	0.01
82	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.01
83	300979	华利集团	925	82,371.25	0.01
84	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
85	688316	青云科技	1,428	71,614.20	0.01
86	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
87	688328	深科达	1,499	65,011.63	0.00
88	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
89	688395	正弦电气	1,627	46,304.42	0.00
90	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
91	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
92	688565	力源科技	2,464	39,916.80	0.00
93	688517	金冠电气	2,892	39,446.88	0.00
94	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
95	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
96	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
97	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
98	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
99	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
100	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
101	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
102	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
103	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
104	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
105	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
106	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
107	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
108	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
109	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
110	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
111	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
112	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
113	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
114	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
115	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
116	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
117	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
118	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
119	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
120	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
121	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00

122	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
123	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
124	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
125	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
126	300937	药易购	244	11,114.20	0.00
127	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
128	603986	兆易创新	60	10,551.00	0.00
129	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
130	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
131	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
132	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
133	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
134	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
135	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
136	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
137	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
138	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
139	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
140	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
141	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
142	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
143	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
144	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
145	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
146	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
147	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
148	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
149	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
150	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
151	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
152	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
153	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
154	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
155	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
156	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
157	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
158	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
159	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
160	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
161	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	600057	厦门象屿	65,718,603.38	4.33
2	002605	姚记科技	54,685,955.36	3.60
3	601058	赛轮轮胎	49,995,440.79	3.29
4	002080	中材科技	31,990,242.44	2.11
5	601233	桐昆股份	27,991,507.00	1.84
6	601677	明泰铝业	24,995,882.46	1.65
7	603589	口子窖	24,988,683.00	1.65
8	601888	中国中免	24,930,494.50	1.64
9	300772	运达股份	21,692,864.17	1.43
10	002353	杰瑞股份	21,419,847.00	1.41
11	603565	中谷物流	21,382,074.52	1.41
12	600219	南山铝业	20,999,252.57	1.38
13	600779	水井坊	20,966,714.00	1.38
14	300088	长信科技	19,998,706.00	1.32
15	002384	东山精密	19,995,158.00	1.32
16	000858	五粮液	19,937,053.00	1.31
17	300280	紫天科技	18,825,162.00	1.24
18	002381	双箭股份	15,997,335.00	1.05
19	601898	中煤能源	14,999,691.00	0.99
20	601717	郑煤机	14,999,647.32	0.99

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	117,960,103.00	7.77
2	000568	泸州老窖	79,434,153.48	5.23
3	000661	长春高新	69,892,701.62	4.60
4	601058	赛轮轮胎	68,776,040.43	4.53
5	600809	山西汾酒	53,899,254.00	3.55
6	002080	中材科技	51,563,628.36	3.40
7	000858	五粮液	39,946,025.50	2.63
8	002677	浙江美大	38,125,972.04	2.51
9	600456	宝钛股份	34,504,114.00	2.27
10	002459	晶澳科技	27,192,851.00	1.79
11	603987	康德莱	24,642,075.40	1.62

12	601233	桐昆股份	24,143,088.10	1.59
13	002641	公元股份	22,046,048.12	1.45
14	002624	完美世界	21,144,838.54	1.39
15	300363	博腾股份	20,476,896.60	1.35
16	600219	南山铝业	20,198,517.70	1.33
17	300725	药石科技	19,966,062.00	1.32
18	002384	东山精密	17,725,201.35	1.17
19	300685	艾德生物	16,983,408.00	1.12
20	603565	中谷物流	16,521,630.50	1.09

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,153,852,676.11
卖出股票收入（成交）总额	1,455,536,719.60

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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投资股指期货。

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投资股指期货。

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投资国债期货。

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投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

2021年10月22日，江苏今世缘酒业股份有限公司（简称“今世缘”）因未及时披露闲置自有资金委托理财事项，违反了《上海证券交易所股票上市规则》，被上海证券交易所上市公司管理一部处以监管警示的监管措施。

截至本报告期末，今世缘（603369）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司作为江苏地产白酒代表公司之一，有继续享受江苏白酒消费升级红利的潜力，结合公司长远规划以及企业基本面和估值水平，具备投资价值。上述监管措施并不影响公司的正常经营和投资逻辑。因此本基金才继续持有今世缘。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	120,462.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,723.65
5	应收申购款	41,130.65

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,316.73

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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	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
37,979	17,612.89	2,758,567.03	0.41%	666,161,241.96	99.59%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年11月21日）基金份额总额	5,959,233,262.60
----------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	846,350,583.70
本报告期基金总申购份额	28,252,621.42
减：本报告期基金总赎回份额	205,683,396.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	668,919,808.99

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

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

本报告期内，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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

自2021年11月5日起，本基金投资范围增加存托凭证，投资策略增加存托凭证投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为10万元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	946,875,878.70	36.90%	389,443.70	20.53%	-
东方证券	1	218,704,512.11	8.52%	203,679.07	10.74%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	381,207,664.10	14.86%	355,018.12	18.71%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	597,508,649.92	23.29%	556,461.22	29.33%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	37,466,831.15	1.46%	34,892.74	1.84%	-
银河证券	1	12,121,572.03	0.47%	11,288.59	0.59%	-
中金公司	1	10,230,260.34	0.40%	9,527.94	0.50%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	本报告期退租一个交易单元
中银国际	1	361,793,889.49	14.10%	336,941.66	17.76%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：本报告期退租中信证券股份有限公司(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席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，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，与被签订的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金租用证券公司交易单元无其他证券投资的情况。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加平	《证券时报》、	2021年01月04日

	安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	
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年01月04日
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年01月05日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加烟台银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年01月06日
5	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年01月16日
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年01月22日
7	诺安价值增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年01月22日
8	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021年02月08日
9	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年02月08日
10	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年03月12日
11	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年03月29日
12	诺安价值增长混合型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站	2021年03月31日
13	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、	2021年03月31日

		《中国证券报》、 《证券日报》	
14	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回(转换、保有)份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年03月31日
15	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年04月01日
16	诺安价值增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年04月22日
17	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年04月22日
18	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021年04月28日
19	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2021年05月29日
20	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年06月11日
21	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年06月21日
22	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021年06月26日
23	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年06月30日
24	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年06月30日
25	诺安价值增长混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2021年07月21日
26	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年07月21日

27	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加招商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》	2021年07月31日
28	诺安基金管理有限公司关于董事长任职的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年08月27日
29	诺安基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年08月31日
30	诺安价值增长混合型证券投资基金2021年中期报告	基金管理人网站	2021年08月31日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年10月12日
32	诺安基金管理有限公司旗下基金2021年第3季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年10月27日
33	诺安价值增长混合型证券投资基金2021年第3季度报告	基金管理人网站	2021年10月27日
34	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加新时代证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年10月29日
35	诺安基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年11月01日
36	诺安价值增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年11月02日
37	诺安价值增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年11月02日
38	诺安价值增长混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2021年11月02日
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修改基金合同、托管协议的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年11月05日
40	诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021年11月05日
41	诺安价值增长混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021年11月05日

42	诺安价值增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第2期	基金管理人网站	2021年11月10日
43	诺安基金管理有限公司关于旗下30只基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年11月10日
44	诺安价值增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年11月10日
45	诺安基金管理有限公司关于督察长任职的公告	《上海证券报》	2021年12月10日
46	诺安基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金销售相关业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021年12月14日

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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	-	-	-	-	-	-
个人	1	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过20%的情形，敬请投资者留意。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安价值增长股票证券投资基金募集的文件。

②《诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》。

③《诺安价值增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价值增长股票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报告期内诺安价值增长混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司

2022年03月31日