

诺安成长混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61

7.12	投资组合报告附注	61
§ 8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 9	开放式基金份额变动	62
§ 10	重大事件揭示	63
10.1	基金份额持有人大会决议	63
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8	其他重大事件	65
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12	备查文件目录	68
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安成长混合型证券投资基金
基金简称	诺安成长混合
基金主代码	320007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 03 月 10 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,406,004,039.83 份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的企业,同时兼顾企业成长能力的可持续性,并对其投资价值做出定性及定量分析,力图在享受到企业成长溢价的同时获得长期稳定的回报。
投资策略	<p>本基金具体的投资策略由资产配置、股票投资、存托凭证投资、债券投资和权证投资五部分构成：</p> <p>(1) 在资产配置方面,本基金采用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方式进行。</p> <p>(2) 在股票投资方面,本基金投资于成长性企业的比例不小于本基金所持股票资产的 80%。</p> <p>(3) 在存托凭证投资方面,本基金将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。</p> <p>(4) 在债券投资方面,本基金将实施利率预测策略、收益率曲线模拟策略、收益率溢价策略、个券估值策略以及无风险套利策略等投资策略,力求获取高于债券市场平均水平的投资回报。</p> <p>(5) 在权证投资方面,本基金主要运用价值发现和价差策略。作为辅助性投资工具,本基金结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-436,708,111.89
本期利润	-6,689,255,569.62
加权平均基金份额本期利润	-0.4556
本期加权平均净值利润率	-27.57%
本期基金份额净值增长率	-23.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	-12,977,457,831.75
期末可供分配基金份额利润	-0.7910
期末基金资产净值	26,635,862,746.04
期末基金份额净值	1.624
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	143.24%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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
过去一个月	6.49%	2.16%	6.25%	0.73%	0.24%	1.43%
过去三个月	-0.73%	2.58%	4.08%	1.03%	-4.81%	1.55%
过去六个月	-23.32%	2.31%	-6.33%	1.02%	-16.99%	1.29%
过去一年	-24.01%	2.26%	-7.02%	0.85%	-16.99%	1.41%
过去三年	107.67%	2.47%	7.55%	0.87%	100.12%	1.60%
自基金合同生效起至今	143.24%	1.93%	107.36%	1.16%	35.88%	0.77%

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

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



§ 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十只开放式基金：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、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、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、诺安优选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、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡嵩松	本基金基金经理	2019 年 02 月 20 日	-	7 年	博士, 具有基金从业资格。曾先后任职于中国科学院计算技术研究所、天津飞腾信息技术有限公司、华泰证券股份有限公司, 2017 年 11 月加入诺安基金管理有限公司, 历任研究员, 现任投资管理部副总经理。2019 年 2 月起任诺安成长混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 3 月起任诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 5 月起任诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注: ①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间, 本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, 遵守了基金合同的规定, 遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

投资研究方面, 公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库, 在此基础上, 不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同, 建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备

选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年开年市场不平静，元旦过后，受美联储加息预期的影响，市场风险偏好急剧下降，出现了疯狂杀估值的阶段，尤其是高位的赛道股首当其冲，半导体、新能源、军工等成长赛道跌幅居前，消费、医药等赛道持续低迷；2 月爆发的俄乌冲突进一步冲击全球投资者的风险偏好，外资对全球新兴市场的投资呈现出了加速流出的趋势；而新一轮全球及国内疫情的爆发，投资者对于未来经济的担忧主导了市场，海外通胀高企，流动性收紧，国内疫情带来的经济增速压力大，市场渐渐只聚焦于稳增长的相关板块，对于具有长期产业趋势的成长板块完全规避，造成成长赛道一季度出现了单边下跌的行情。

二季度因为疫情的影响，芯片行业最大的下游应用消费电子面临较大压力。进入六月份跌幅有所收窄，但是依然没有恢复到去年同期的正常水平。虽然某些品类在电动车、新能源等下游拉动下有结构性的机会，但相比整个行业的疲软杯水车薪。在宏观环境相对友好的情况下，芯片板块真正

的独立行情需要消费电子出现实质性的拐点，而这个时间点渐行渐近，但仍需观察。另外，芯片设备材料板块景气度持续高企，中报同比预期接近翻倍增长，而板块却在情绪的影响下持续向下，基本面和股价出现了明显的背离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.624 元，本报告期内基金份额净值增长率为-23.32%，同期业绩比较基准收益率为-6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年半导体行业波动较大，因为疫情，行业供给和需求会受到一定程度的影响，但长期看，由科技创新带来的行业景气度不会轻易改变。另外我们一直强调，我国半导体产业未来最大的机会在国产替代，今年就是国产替代的元年。在这种时候，我们不应该被当前市场的下跌所影响，不应该对产业的发展视而不见。我们的投资理念遵循产业投资，伴随产业的优秀公司成长，但不可避免的是，有些阶段市场会对一些扰动做出极致的反应，这时候就需要我们保持理性分析客观判断。

投资是反人性的，逆势投资是痛苦的，而重要的投资机会往往出现在市场出现重大分歧的时候。对产业保持理性分析客观判断，陪伴中国科技成长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安成长混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022 年 06 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,643,468,646.72	2,132,139,942.72
结算备付金		686,376.68	6,161,994.52
存出保证金		1,321,379.90	4,572,939.49
交易性金融资产	6.4.7.2	25,049,564,424.62	25,372,866,841.72
其中：股票投资		25,049,564,424.62	25,372,866,841.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		79,884,601.16	54,870,245.15
应收股利		-	-
应收申购款		320,683,876.31	58,485,765.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	210,764.57
资产总计		27,095,609,305.39	27,629,308,493.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		420,161,345.39	174,264,229.03
应付管理人报酬		30,020,361.84	35,408,647.00
应付托管费		5,003,393.66	5,901,441.17
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,561,458.46	5,371,468.04
负债合计		459,746,559.35	220,945,785.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	16,406,004,039.83	12,942,629,576.83
未分配利润	6.4.7.8	10,229,858,706.21	14,465,733,131.11
净资产合计		26,635,862,746.04	27,408,362,707.94
负债和净资产总计		27,095,609,305.39	27,629,308,493.18

注：(1) 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.624 元，基金份额总额 16,406,004,039.83 份。

(2) 以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：诺安成长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-6,478,864,370.91	7,075,588,245.64
1. 利息收入		3,348,917.59	4,828,144.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,348,917.59	4,386,315.04
债券利息收入		-	441,829.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-247,361,030.98	2,729,517,165.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-280,568,299.99	2,705,808,032.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	16,331.85	-213,728.80
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	33,190,937.16	23,922,862.00
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,252,547,457.73	4,266,663,877.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,695,200.21	74,579,057.56
减：二、营业总支出		210,391,198.71	294,662,991.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	180,232,400.21	216,274,158.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,038,733.37	36,045,692.96

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	120,065.13	42,343,140.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,689,255,569.62	6,780,925,253.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,689,255,569.62	6,780,925,253.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,689,255,569.62	6,780,925,253.92

注：以上比较财务信息已根据最新的《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安成长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	12,942,629,576.83	-	14,465,733,131.11	27,408,362,707.94
二、本期期初净资产（基金净值）	12,942,629,576.83	-	14,465,733,131.11	27,408,362,707.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,463,374,463.00	-	-4,235,874,424.90	-772,499,961.90
（一）、综合收益总额	-	-	-6,689,255,569.62	-6,689,255,569.62
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,463,374,463.00	-	2,453,381,144.72	5,916,755,607.72
其中：1. 基金申购款	10,372,282,445.91	-	6,788,783,240.07	17,161,065,685.98
2. 基金赎回	-6,908,907,982.91	-	-4,335,402,095.35	-11,244,310,078.26

款				
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	16,406,004,039.83	-	10,229,858,706.21	26,635,862,746.04
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	18,956,430,702.08	-	13,819,214,317.18	32,775,645,019.26
二、本期期初净资产(基金净值)	18,956,430,702.08	-	13,819,214,317.18	32,775,645,019.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,768,065,594.30	-	1,169,687,435.14	-4,598,378,159.16
(一)、综合收益总额	-	-	6,780,925,253.92	6,780,925,253.92
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,768,065,594.30	-	-5,611,237,818.78	-11,379,303,413.08
其中: 1. 基金申购款	20,173,494,673.23	-	15,543,851,758.18	35,717,346,431.41
2. 基金赎回款	-25,941,560,267.53	-	-21,155,089,576.96	-47,096,649,844.49
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	13,188,365,107.78	-	14,988,901,752.32	28,177,266,860.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

齐斌

基金管理人负责人

田冲

主管会计工作负责人

薛有为

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围界定为股票、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,主要投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票;债券投资主要包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债;权证投资等新的金融产品将在法律法规允许的范围内进行投资;现金资产主要投资于各类银行存款。本基金的投资组合比例为:股票、存托凭证占基金资产的比例为60-95%,其中投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票不低于股票投资的80%;债券投资、现金等固定收益金融工具占基金资产的比例为5-40%,其中现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。于2020年8月12日前,本基金的业绩比较基准为:标普中国A股综合指数×80%+上证国债指数×20%;自2020年8月12日起,本基金的业绩比较基准变更为:中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益

的金融资产，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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相关交易费用确认为投资收益，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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 2,132,139,942.72 元、6,161,994.52 元、4,572,939.49 元、210,764.57 元、54,870,245.15 元和 58,485,765.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 2,132,345,876.59 元、6,164,767.42 元、4,574,997.29 元、0.00 元、54,870,245.15 元和 58,485,765.01 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，

金额为 25,372,866,841.72 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 25,372,866,841.72 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 174,264,229.03 元、35,408,647.00 元、5,901,441.17 元、4,477,808.54 元和 653,659.50 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 174,264,229.03 元、35,408,647.00 元、5,901,441.17 元、4,477,808.54 元和 653,659.50 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值

税政策有关问题的补充通知》、财税(2017)56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税(2017)90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	1,643,468,646.72
等于：本金	1,643,309,719.95
加：应计利息	158,926.77
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,643,468,646.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	27,900,534,889.20	-	25,049,564,424.62	-2,850,970,464.58
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	27,900,534,889.20	-	25,049,564,424.62	-2,850,970,464.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,517,207.72
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,925,236.00
其中：交易所市场	2,925,236.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,014.74
合计	4,561,458.46

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,942,629,576.83	12,942,629,576.83
本期申购	10,372,282,445.91	10,372,282,445.91
本期赎回（以“-”号填列）	-6,908,907,982.91	-6,908,907,982.91
本期末	16,406,004,039.83	16,406,004,039.83

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。

6.4.7.8 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	-9,858,282,327.96	24,324,015,459.07	14,465,733,131.11
本期利润	-436,708,111.89	-6,252,547,457.73	-6,689,255,569.62
本期基金份额交易产生的变动数	-2,682,467,391.90	5,135,848,536.62	2,453,381,144.72
其中：基金申购款	-8,031,170,270.32	14,819,953,510.39	6,788,783,240.07
基金赎回款	5,348,702,878.42	-9,684,104,973.77	-4,335,402,095.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,977,457,831.75	23,207,316,537.96	10,229,858,706.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	3,229,491.93
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	55,021.78
其他	64,403.88
合计	3,348,917.59

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	918,109,049.20
减：卖出股票成本总额	1,191,397,245.57
减：交易费用	7,280,103.62
买卖股票差价收入	-280,568,299.99

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益—利息收入	25,838.60
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-9,506.75
债券投资收益—赎回差价收入	-
债券投资收益—申购差价收入	-
合计	16,331.85

6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,385,342.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,992,814.00

减：应计利息总额	401,934.22
减：交易费用	100.75
买卖债券差价收入	-9,506.75

6.4.7.12 贵金属投资收益

6.4.7.12.1 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	33,190,937.16
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	33,190,937.16

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-6,252,547,457.73
—股票投资	-6,252,547,457.73
—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	-6,252,547,457.73

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	17,632,831.72
基金转换费收入	62,368.49
合计	17,695,200.21

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,050.39
合计	120,065.13

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,232,400.21	216,274,158.18
其中：支付销售机构的客户维护费	71,063,627.33	80,944,692.08

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,038,733.37	36,045,692.96

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年 06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 06月30日
基金合同生效日(2009年03月10日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	25,487,680.54	25,487,680.54
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	25,487,680.54	25,487,680.54
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	0.16%	0.19%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,643,468,646.72	3,229,491.93	1,873,025,344.88	4,182,698.43

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2022 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300655	晶瑞电材	2022年01月28日	6个月	非公开发行锁定	24.58	18.58	3,079,904	75,693,160.28	57,224,616.32	-
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年03月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022年03月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股锁定	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股锁定	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年06月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年04月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年05月27日	6个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022年02月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年03月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022年03月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022年05月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年01月07日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年05月25日	6个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301163	宏德股份	2022年04月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
30117	中科	2022年	1个月	新股未	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-

5	环保	06月30日	内(含)	上市						
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301181	标榜股份	2022年02月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年02月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年03月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022年03月10日	6个月	新股锁定	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301220	亚香股份	2022年06月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年03月02日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022年01月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

		日								
301236	软通动力	2022年03月08日	6个月	新股锁定	48.59	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-
301237	和顺科技	2022年03月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年06月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301248	杰创智能	2022年04月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022年03月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年03月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年04月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022年04月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022年05月27日	6个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-

301302	华如科技	2022年06月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688126	沪硅产业	2022年03月07日	6个月	非公开发行锁定	20.83	22.19	15,218,434	316,999,980.22	337,697,050.46	-
688171	纬德信息	2022年01月20日	6个月	新股锁定	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17	-
688220	翱捷科技	2022年01月06日	6个月	新股锁定	164.54	68.59	12,371	2,035,524.34	848,526.89	-
688237	超卓航科	2022年06月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688400	凌云光	2022年06月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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

本基金持有的流通受限股票“300655 晶瑞电材”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 10 股转增 6.877934 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“301103 何氏眼科”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 10 股转增 3 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“301109 军信股份”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 10 股转增 5 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“301219 腾远钴业”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 10 股转增 8 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

本基金持有的流通受限股票“301236 软通动力”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 10 股转增 5 股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年06月30 日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,643,468,646.72	-	-	-	-	1,643,468,646.72
结算备付金	686,376.68	-	-	-	-	686,376.68
存出保证金	1,321,379.90	-	-	-	-	1,321,379.90
交易性金融资产	-	-	-	-	25,049,564,424.62	25,049,564,424.62
应收清算款	-	-	-	-	79,884,601.16	79,884,601.16
应收申购款	956,693.92	-	-	-	319,727,182.39	320,683,876.31
资产总计	1,646,433,097.22	-	-	-	25,449,176,208.17	27,095,609,305.39
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	420,161,345.39	420,161,345.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	30,020,361.84	30,020,361.84
应付托管费	-	-	-	-	5,003,393.66	5,003,393.66
其他负债	-	-	-	-	4,561,458.46	4,561,458.46
负债总计	-	-	-	-	459,746,559.35	459,746,559.35
利率敏感度缺口	1,646,433,097.22	-	-	-	-24,989,429,648.82	26,635,862,746.04
上年度末 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	2,132,139,942.72	-	-	-	-	2,132,139,942.72
结算备付金	6,161,994.52	-	-	-	-	6,161,994.52
存出保证金	4,572,939.49	-	-	-	-	4,572,939.49
交易性金融资产	-	-	-	-	25,372,866,841.72	25,372,866,841.72
应收清算款	-	-	-	-	54,870,245.15	54,870,245.15
其他资产	-	-	-	-	210,764.57	210,764.57
应收申购款	179,470.34	-	-	-	58,306,294.67	58,485,765.01
资产总计	2,143,054,347.07	-	-	-	25,486,254,146.11	27,629,308,493.18
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	174,264,229.03	174,264,229.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	35,408,647.00	35,408,647.00
应付托管费	-	-	-	-	5,901,441.17	5,901,441.17
其他负债	-	-	-	-	5,371,468.04	5,371,468.04
负债总计	-	-	-	-	220,945,785.24	220,945,785.24
利率敏感度缺口	2,143,054,347.07	-	-	-	-25,265,308,360.87	27,408,362,707.94

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证投资占基金资产的比例为 60-95%，其中投资于具有良好成长性及较高内在价值的上市公司股票不低于股票投资的 80%；债券投资、现金等固定收益金融工具占基金资产的比例为 5-40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	25,049,564,424.62	94.04	25,372,866,841.72	92.57

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	25,049,564,424.62	94.04	25,372,866,841.72	92.57

6.4.13.4.3.2 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(2022年06月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	1,607,098,265.49	1,283,992,983.91
业绩比较基准下降 5%	-1,607,098,265.49	-1,283,992,983.91	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年末 2021年12月31日
第一层次	24,650,632,734.19	24,461,061,465.75
第二层次	908,968.95	911,805,375.97
第三层次	398,022,721.48	-
合计	25,049,564,424.62	25,372,866,841.72

6.4.14.2.2 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;本基金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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,049,564,424.62	92.45
	其中:股票	25,049,564,424.62	92.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,644,155,023.40	6.07
8	其他各项资产	401,889,857.37	1.48
9	合计	27,095,609,305.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	196,714.17	0.00

B	采矿业	1,401,548.08	0.01
C	制造业	23,053,006,441.99	86.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,906,411.89	0.02
E	建筑业	277,679.58	0.00
F	批发和零售业	1,596,369.11	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	143,310.87	0.00
H	住宿和餐饮业	148,942.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,792,645,414.93	6.73
J	金融业	1,492,350.81	0.01
K	房地产业	146,719.44	0.00
L	租赁和商务服务业	186,532,910.13	0.70
M	科学研究和技术服务业	3,515,469.34	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,836,528.96	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,624.14	0.00
Q	卫生和社会工作	570,398.55	0.00
R	文化、体育和娱乐业	127,590.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	25,049,564,424.62	94.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603501	韦尔股份	15,232,908	2,635,750,071.24	9.90
2	300782	卓胜微	19,331,218	2,609,714,430.00	9.80
3	002371	北方华创	9,374,578	2,597,883,055.36	9.75
4	603986	兆易创新	15,422,650	2,193,255,056.50	8.23
5	688012	中微公司	17,891,218	2,088,799,701.50	7.84
6	300661	圣邦股份	11,272,657	2,051,849,027.14	7.70
7	600703	三安光电	77,081,692	1,894,667,989.36	7.11
8	300223	北京君正	17,558,882	1,865,631,212.50	7.00
9	688126	沪硅产业	63,489,043	1,446,955,645.28	5.43
10	688981	中芯国际	31,117,880	1,405,594,639.60	5.28
11	002268	卫士通	22,637,577	971,378,429.07	3.65
12	688521	芯原股份	16,365,029	808,432,432.60	3.04

13	600745	闻泰科技	9,229,391	785,513,468.01	2.95
14	300655	晶瑞电材	17,242,419	330,561,155.82	1.24
15	688339	亿华通	3,082,381	303,244,642.78	1.14
16	688082	盛美上海	2,848,976	269,997,455.52	1.01
17	688072	拓荆科技	1,242,299	192,680,574.90	0.72
18	300280	紫天科技	8,088,880	186,286,906.40	0.70
19	688234	天岳先进	2,703,484	181,133,428.00	0.68
20	688153	唯捷创芯	2,452,873	125,096,523.00	0.47
21	600905	三峡能源	907,763	5,709,829.27	0.02
22	688303	大全能源	48,536	3,315,979.52	0.01
23	688223	晶科能源	213,000	3,180,090.00	0.01
24	688348	昱能科技	5,644	2,754,272.00	0.01
25	688052	纳芯微	6,090	2,307,866.40	0.01
26	688032	禾迈股份	2,534	2,207,114.00	0.01
27	688187	时代电气	33,865	2,200,886.35	0.01
28	688327	云从科技	88,678	2,199,214.40	0.01
29	601728	中国电信	562,873	2,099,516.29	0.01
30	688297	中无人机	37,246	1,980,742.28	0.01
31	688235	百济神州	19,217	1,908,824.61	0.01
32	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
33	688349	三一重能	32,650	1,330,487.50	0.00
34	301238	瑞泰新材	34,966	1,296,327.26	0.00
35	688120	华海清科	4,822	1,197,784.80	0.00
36	688281	华秦科技	4,386	1,153,518.00	0.00
37	601995	中金公司	24,951	1,110,069.99	0.00
38	688538	和辉光电	375,156	1,005,418.08	0.00
39	688819	天能股份	28,382	981,449.56	0.00
40	301155	海力风电	10,533	958,503.00	0.00
41	688779	长远锂科	43,086	861,720.00	0.00
42	688220	翱捷科技	12,371	848,526.89	0.00
43	300919	中伟股份	6,093	754,922.70	0.00
44	688232	新点软件	18,893	710,754.66	0.00
45	301236	软通动力	20,746	680,321.38	0.00
46	300979	华利集团	9,246	675,697.68	0.00
47	300999	金龙鱼	12,114	654,398.28	0.00
48	688707	振华新材	8,130	615,197.10	0.00
49	688686	奥普特	2,330	602,654.50	0.00
50	688197	首药控股	24,261	598,761.48	0.00
51	688385	复旦微电	8,986	585,797.34	0.00
52	688778	厦钨新能	5,075	565,710.25	0.00
53	688680	海优新材	2,795	555,366.50	0.00

54	688425	铁建重工	135,282	550,597.74	0.00
55	688083	中望软件	2,572	538,628.24	0.00
56	688107	安路科技	7,821	537,302.70	0.00
57	688110	东芯股份	14,044	532,548.48	0.00
58	301035	润丰股份	6,438	530,813.10	0.00
59	301219	腾远钴业	5,762	530,176.28	0.00
60	688091	上海谊众	3,294	525,063.60	0.00
61	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.00
62	688105	诺唯赞	6,180	524,682.00	0.00
63	300896	爱美客	852	511,208.52	0.00
64	688739	成大生物	9,882	502,104.42	0.00
65	688798	艾为电子	3,592	488,080.96	0.00
66	688660	电气风电	51,238	485,223.86	0.00
67	688499	利元亨	2,149	475,573.70	0.00
68	688728	格科微	23,033	472,406.83	0.00
69	688696	极米科技	1,502	462,420.74	0.00
70	301200	大族数控	8,566	460,781.44	0.00
71	301050	雷电微力	4,192	425,739.52	0.00
72	688408	中信博	4,450	411,536.00	0.00
73	688279	峰昭科技	5,505	406,929.60	0.00
74	688057	金达莱	21,850	404,006.50	0.00
75	688772	珠海冠宇	12,960	397,872.00	0.00
76	688131	皓元医药	2,737	388,900.33	0.00
77	301029	怡合达	4,617	376,285.50	0.00
78	300973	立高食品	3,593	373,492.35	0.00
79	688046	药康生物	12,070	353,651.00	0.00
80	301216	万凯新材	11,195	351,287.05	0.00
81	688238	和元生物	12,836	349,909.36	0.00
82	688262	国芯科技	7,129	347,039.72	0.00
83	301207	华兰疫苗	5,687	336,163.36	0.00
84	300953	震裕科技	2,394	327,954.06	0.00
85	301215	中汽股份	47,421	326,493.09	0.00
86	301109	军信股份	18,376	312,961.26	0.00
87	688320	禾川科技	6,048	312,076.80	0.00
88	688383	新益昌	2,701	307,238.75	0.00
89	688639	华恒生物	2,302	303,127.36	0.00
90	301090	华润材料	27,635	301,497.85	0.00
91	688112	鼎阳科技	4,901	299,647.14	0.00
92	300910	瑞丰新材	4,736	299,409.92	0.00
93	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.00
94	301099	雅创电子	3,510	293,014.80	0.00

95	688151	华强科技	12,238	292,121.06	0.00
96	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
97	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.00
98	688690	纳微科技	3,477	280,976.37	0.00
99	688508	芯朋微	3,729	277,810.50	0.00
100	301089	拓新药业	2,198	276,112.76	0.00
101	688248	南网科技	11,763	271,960.56	0.00
102	688182	灿勤科技	18,387	270,840.51	0.00
103	688306	均普智能	47,094	260,429.82	0.00
104	688700	东威科技	3,049	254,103.66	0.00
105	688733	壹石通	3,409	250,186.51	0.00
106	688665	四方光电	1,687	249,676.00	0.00
107	688533	上声电子	3,493	249,539.92	0.00
108	688800	瑞可达	1,967	248,451.77	0.00
109	301069	凯盛新材	5,386	248,348.46	0.00
110	688280	精进电动	21,211	248,168.70	0.00
111	688776	国光电气	1,447	245,975.53	0.00
112	605117	德业股份	878	245,743.42	0.00
113	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.00
114	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.00
115	688192	迪哲医药	8,926	238,681.24	0.00
116	688077	大地熊	2,829	238,512.99	0.00
117	688148	芳源股份	11,860	236,844.20	0.00
118	688190	云路股份	3,026	235,271.50	0.00
119	300894	火星人	6,279	234,771.81	0.00
120	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.00
121	300900	广联航空	8,782	234,479.40	0.00
122	688276	百克生物	3,486	231,296.10	0.00
123	688789	宏华数科	1,400	230,482.00	0.00
124	688578	艾力斯	10,734	226,487.40	0.00
125	301039	中集车辆	20,640	223,531.20	0.00
126	688317	之江生物	5,740	214,618.60	0.00
127	301096	百诚医药	2,714	214,406.00	0.00
128	688668	鼎通科技	3,037	213,622.58	0.00
129	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.00
130	301102	兆讯传媒	6,414	211,821.06	0.00
131	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.00
132	688269	凯立新材	1,941	205,746.00	0.00
133	301060	兰卫医学	5,869	205,532.38	0.00
134	688699	明微电子	1,869	202,711.74	0.00
135	301018	申菱环境	7,811	201,601.91	0.00

136	688711	宏微科技	2,611	199,219.30	0.00
137	301153	中科江南	3,973	196,933.29	0.00
138	301256	华融化学	18,308	196,408.08	0.00
139	300902	国安达	5,510	195,109.10	0.00
140	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
141	300834	星辉环材	6,349	191,974.69	0.00
142	688529	豪森股份	6,125	187,915.00	0.00
143	301127	天源环保	16,843	187,462.59	0.00
144	301149	隆华新材	12,138	185,832.78	0.00
145	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.00
146	688206	概伦电子	6,000	182,400.00	0.00
147	688566	吉贝尔	9,882	181,631.16	0.00
148	301221	光庭信息	2,791	180,940.53	0.00
149	688135	利扬芯片	5,658	178,113.84	0.00
150	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.00
151	688601	力芯微	1,174	176,100.00	0.00
152	688386	泛亚微透	3,217	174,650.93	0.00
153	688667	菱电电控	1,191	172,016.13	0.00
154	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.00
155	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.00
156	688212	澳华内镜	3,496	163,612.80	0.00
157	688308	欧科亿	2,457	163,537.92	0.00
158	688677	海泰新光	1,768	162,638.32	0.00
159	688621	阳光诺和	1,485	162,459.00	0.00
160	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.00
161	688766	普冉股份	986	160,846.18	0.00
162	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.00
163	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.00
164	301248	杰创智能	4,716	153,047.20	0.00
165	688282	理工导航	3,185	152,784.45	0.00
166	688265	南模生物	2,374	152,007.22	0.00
167	301073	君亭酒店	2,148	148,942.32	0.00
168	300982	苏文电能	3,170	148,863.20	0.00
169	301166	优宁维	2,528	148,798.08	0.00
170	300909	汇创达	5,787	148,783.77	0.00
171	301168	通灵股份	3,281	147,907.48	0.00
172	688161	威高骨科	3,069	147,895.11	0.00
173	300917	特发服务	4,739	146,719.44	0.00
174	688345	博力威	2,332	143,348.04	0.00
175	301136	招标股份	7,172	143,081.40	0.00
176	688087	英科再生	2,469	142,881.03	0.00

177	688173	希荻微	4,236	142,117.80	0.00
178	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.00
179	688059	华锐精密	1,023	141,153.54	0.00
180	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.00
181	301180	万祥科技	6,536	136,929.20	0.00
182	688767	博拓生物	2,220	136,885.20	0.00
183	688097	博众精工	3,983	135,621.15	0.00
184	300986	志特新材	3,685	135,608.00	0.00
185	301118	恒光股份	3,142	135,200.26	0.00
186	301258	富士莱	2,942	132,548.81	0.00
187	688136	科兴制药	4,981	131,996.50	0.00
188	301088	戎美股份	7,036	131,291.76	0.00
189	688560	明冠新材	3,832	131,207.68	0.00
190	301097	天益医疗	2,486	130,023.27	0.00
191	301100	风光股份	5,985	129,156.30	0.00
192	688076	诺泰生物	4,984	128,985.92	0.00
193	301199	迈赫股份	4,014	128,608.56	0.00
194	688259	创耀科技	1,595	128,509.15	0.00
195	300932	三友联众	6,885	126,615.15	0.00
196	300941	创识科技	5,984	125,963.20	0.00
197	688049	炬芯科技	3,260	124,075.60	0.00
198	688225	亚信安全	5,534	124,072.28	0.00
199	300997	欢乐家	9,279	123,967.44	0.00
200	300925	法本信息	10,197	121,854.15	0.00
201	688626	翔宇医疗	3,652	121,465.52	0.00
202	300903	科翔股份	8,595	121,275.45	0.00
203	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.00
204	301179	泽宇智能	2,941	120,022.21	0.00
205	688079	美迪凯	10,622	119,816.16	0.00
206	301116	益客食品	5,764	119,695.02	0.00
207	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
208	688670	金迪克	2,310	116,932.20	0.00
209	688625	呈和科技	2,672	116,606.08	0.00
210	301237	和顺科技	2,610	116,160.66	0.00
211	300930	屹通新材	3,220	115,662.40	0.00
212	300940	南极光	4,909	115,508.77	0.00
213	688257	新锐股份	2,899	114,858.38	0.00
214	688510	航亚科技	5,991	114,787.56	0.00
215	688305	科德数控	1,496	114,249.52	0.00
216	300996	普联软件	3,857	113,974.35	0.00
217	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.00

218	301126	达嘉维康	6,615	113,314.95	0.00
219	301137	哈焊华通	6,431	111,743.67	0.00
220	688663	新风光	3,279	111,387.63	0.00
221	301108	洁雅股份	2,800	110,796.00	0.00
222	301078	孩子王	7,551	110,697.66	0.00
223	688682	霍莱沃	1,324	109,931.72	0.00
224	688323	瑞华泰	4,513	109,349.99	0.00
225	605499	东鹏饮料	632	107,983.52	0.00
226	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.00
227	301185	鸥玛软件	5,776	106,798.24	0.00
228	688678	福立旺	4,198	106,503.26	0.00
229	300968	格林精密	11,620	105,277.20	0.00
230	688689	银河微电	3,258	105,233.40	0.00
231	688662	富信科技	2,556	104,923.80	0.00
232	688201	信安世纪	3,151	104,802.26	0.00
233	688636	智明达	918	104,092.02	0.00
234	301111	粤万年青	3,783	103,729.86	0.00
235	301017	漱玉平民	5,550	102,897.00	0.00
236	301196	唯科科技	2,705	102,319.16	0.00
237	300942	易瑞生物	4,428	102,286.80	0.00
238	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.00
239	301092	争光股份	3,230	101,615.80	0.00
240	301222	浙江恒威	3,315	101,431.46	0.00
241	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.00
242	688575	亚辉龙	4,809	100,604.28	0.00
243	301046	能辉科技	2,891	100,057.51	0.00
244	301015	百洋医药	4,614	99,570.12	0.00
245	003022	联泓新科	2,995	99,523.85	0.00
246	300907	康平科技	4,724	97,645.08	0.00
247	688676	金盘科技	3,750	97,500.00	0.00
248	688488	艾迪药业	9,934	97,452.54	0.00
249	601825	沪农商行	15,480	97,059.60	0.00
250	688698	伟创电气	4,751	96,682.85	0.00
251	688175	高凌信息	2,851	96,477.84	0.00
252	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.00
253	688315	诺禾致源	3,711	95,632.47	0.00
254	301006	迈拓股份	5,051	94,958.80	0.00
255	301020	密封科技	4,210	94,725.00	0.00
256	688687	凯因科技	5,354	94,551.64	0.00
257	301130	西点药业	2,370	94,254.90	0.00
258	300993	玉马遮阳	7,375	94,252.50	0.00

259	301048	金鹰重工	8,424	92,748.24	0.00
260	688070	纵横股份	2,407	92,693.57	0.00
261	300967	晓鸣股份	5,061	91,148.61	0.00
262	300912	凯龙高科	5,117	91,031.43	0.00
263	300918	南山智尚	10,626	90,852.30	0.00
264	688737	中自科技	2,186	90,347.38	0.00
265	688163	赛伦生物	3,607	89,814.30	0.00
266	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.00
267	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.00
268	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.00
269	301138	华研精机	2,849	87,606.75	0.00
270	301021	英诺激光	2,899	87,549.80	0.00
271	688661	和林微纳	1,452	87,061.92	0.00
272	300962	中金辐照	5,757	86,930.70	0.00
273	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.00
274	688609	九联科技	10,372	86,502.48	0.00
275	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.00
276	688793	倍轻松	1,454	85,800.54	0.00
277	300966	共同药业	2,858	85,311.30	0.00
278	300985	致远新能	2,945	84,521.50	0.00
279	300926	博俊科技	3,584	83,686.40	0.00
280	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.00
281	605376	博迁新材	1,421	82,844.30	0.00
282	300614	百川畅银	3,283	82,600.28	0.00
283	688611	杭州柯林	1,400	82,292.00	0.00
284	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.00
285	688628	优利德	2,789	81,968.71	0.00
286	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.00
287	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.00
288	688613	奥精医疗	2,617	80,969.98	0.00
289	688619	罗普特	5,856	80,812.80	0.00
290	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.00
291	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.00
292	301133	金钟股份	2,860	79,422.20	0.00
293	301028	东亚机械	7,329	79,299.78	0.00
294	688683	莱尔科技	3,296	79,235.84	0.00
295	301158	德石股份	3,783	78,697.42	0.00
296	300937	药易购	2,434	77,936.68	0.00
297	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.00
298	300978	东箭科技	5,930	77,386.50	0.00
299	688160	步科股份	2,771	77,366.32	0.00

300	301045	天禄科技	3,350	77,284.50	0.00
301	301228	实朴检测	3,721	76,823.46	0.00
302	601568	北元集团	12,108	76,764.72	0.00
303	301198	喜悦智行	3,397	76,602.35	0.00
304	300945	曼卡龙	4,731	76,074.48	0.00
305	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.00
306	301026	浩通科技	2,027	74,755.76	0.00
307	603529	爱玛科技	1,427	74,746.26	0.00
308	688685	迈信林	2,612	74,703.20	0.00
309	688195	腾景科技	2,693	74,649.96	0.00
310	301098	金埔园林	3,069	74,423.25	0.00
311	688129	东来技术	5,033	73,783.78	0.00
312	301040	中环海陆	2,401	73,302.53	0.00
313	688633	星球石墨	1,558	72,478.16	0.00
314	300922	天秦装备	4,008	71,983.68	0.00
315	301038	深水规院	3,458	71,891.82	0.00
316	688219	会通股份	7,336	71,305.92	0.00
317	003035	南网能源	11,046	70,142.10	0.00
318	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.00
319	301012	扬电科技	1,691	69,347.91	0.00
320	301027	华蓝集团	2,856	69,343.68	0.00
321	605358	立昂微	1,026	69,131.88	0.00
322	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.00
323	688669	聚石化学	2,681	68,714.03	0.00
324	301066	万事利	4,810	68,590.60	0.00
325	688768	容知日新	907	68,551.06	0.00
326	600906	财达证券	7,597	68,297.03	0.00
327	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.00
328	300956	英力股份	3,707	67,244.98	0.00
329	300987	川网传媒	3,905	65,877.35	0.00
330	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
331	301002	崧盛股份	2,601	64,686.87	0.00
332	300975	商络电子	7,375	64,678.75	0.00
333	688113	联测科技	1,415	64,453.25	0.00
334	688319	欧林生物	3,412	64,452.68	0.00
335	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.00
336	301055	张小泉	3,541	62,958.98	0.00
337	688799	华纳药厂	1,917	61,631.55	0.00
338	301062	上海艾录	5,225	60,975.75	0.00
339	300998	宁波方正	2,003	60,590.75	0.00
340	300971	博亚精工	2,445	60,269.25	0.00

341	300814	中富电路	3,280	60,024.00	0.00
342	300943	春晖智控	3,813	59,902.23	0.00
343	688590	新致软件	4,171	59,770.43	0.00
344	688329	艾隆科技	1,846	59,718.10	0.00
345	688571	杭华股份	8,200	59,696.00	0.00
346	688597	煜邦电力	3,907	59,347.33	0.00
347	601963	重庆银行	7,472	59,327.68	0.00
348	300958	建工修复	2,993	59,201.54	0.00
349	300952	恒辉安防	3,398	59,125.20	0.00
350	300991	创益通	4,056	58,325.28	0.00
351	688557	兰剑智能	1,812	58,292.04	0.00
352	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.00
353	688216	气派科技	2,000	57,720.00	0.00
354	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.00
355	301011	华立科技	1,750	57,557.50	0.00
356	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
357	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.00
358	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.00
359	301030	仕净科技	2,417	56,364.44	0.00
360	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
361	300972	万辰生物	4,300	55,599.00	0.00
362	688718	唯赛勃	3,145	55,414.90	0.00
363	301010	晶雪节能	2,172	55,060.20	0.00
364	300963	中洲特材	2,830	54,845.40	0.00
365	688191	智洋创新	3,203	54,451.00	0.00
366	688656	浩欧博	1,371	53,647.23	0.00
367	300920	润阳科技	2,503	53,464.08	0.00
368	300950	德固特	3,279	53,447.70	0.00
369	300961	深水海纳	3,936	53,372.16	0.00
370	301025	读客文化	4,027	53,075.86	0.00
371	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.00
372	300931	通用电梯	6,713	51,891.49	0.00
373	688316	青云科技	1,428	51,493.68	0.00
374	300948	冠中生态	3,230	51,260.10	0.00
375	301016	雷尔伟	2,747	51,231.55	0.00
376	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.00
377	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.00
378	003031	中瓷电子	759	49,031.40	0.00
379	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.00
380	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.00
381	688468	科美诊断	3,919	48,321.27	0.00

382	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.00
383	301032	新柴股份	5,124	47,653.20	0.00
384	688618	三旺通信	1,117	47,293.78	0.00
385	301049	超越科技	1,954	46,329.34	0.00
386	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.00
387	688350	富淼科技	2,552	45,910.48	0.00
388	301007	德迈仕	3,022	45,541.54	0.00
389	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.00
390	600032	浙江新能	3,045	44,609.25	0.00
391	300960	通业科技	2,332	43,655.04	0.00
392	301059	金三江	2,581	43,360.80	0.00
393	605589	圣泉集团	1,750	43,172.50	0.00
394	001203	大中矿业	3,809	43,041.70	0.00
395	300992	泰福泵业	1,998	42,577.38	0.00
396	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.00
397	301041	金百泽	2,150	42,376.50	0.00
398	688217	睿昂基因	1,040	42,234.40	0.00
399	300861	美畅股份	454	42,081.26	0.00
400	301037	保立佳	1,923	41,998.32	0.00
401	601156	东航物流	2,090	41,382.00	0.00
402	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.00
403	688555	泽达易盛	3,004	41,154.80	0.00
404	300995	奇德新材	1,909	40,852.60	0.00
405	688109	品茗股份	1,301	40,200.90	0.00
406	300929	华骐环保	2,923	40,191.25	0.00
407	688655	迅捷兴	3,083	39,585.72	0.00
408	600916	中国黄金	3,371	39,440.70	0.00
409	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
410	688328	深科达	1,499	37,699.85	0.00
411	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.00
412	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
413	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.00
414	688659	元琛科技	3,671	34,764.37	0.00
415	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.00
416	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.00
417	688367	工大高科	1,717	34,391.51	0.00
418	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.00
419	688679	通源环境	3,139	34,089.54	0.00
420	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.00
421	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.00
422	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00

423	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.00
424	601665	齐鲁银行	6,731	32,847.28	0.00
425	003021	兆威机电	680	32,483.60	0.00
426	001201	东瑞股份	802	30,941.16	0.00
427	605090	九丰能源	1,526	30,932.02	0.00
428	605338	巴比食品	1,012	30,876.12	0.00
429	601187	厦门银行	5,129	30,568.84	0.00
430	605337	李子园	1,103	30,531.04	0.00
431	603324	盛剑环境	732	29,924.16	0.00
432	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.00
433	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.00
434	688092	爱科科技	1,137	29,289.12	0.00
435	003009	中天火箭	623	29,150.17	0.00
436	300887	谱尼测试	680	29,042.80	0.00
437	605507	国邦医药	1,202	29,028.30	0.00
438	300860	锋尚文化	614	28,999.22	0.00
439	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.00
440	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
441	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.00
442	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.00
443	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.00
444	003026	中晶科技	460	26,712.20	0.00
445	688067	爱威科技	1,259	26,212.38	0.00
446	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
447	688681	科汇股份	1,899	25,313.67	0.00
448	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
449	600935	华塑股份	4,812	25,214.88	0.00
450	605089	味知香	370	24,978.70	0.00
451	003039	顺控发展	1,024	24,729.60	0.00
452	605305	中际联合	508	24,597.36	0.00
453	601921	浙版传媒	3,154	24,538.12	0.00
454	300869	康泰医学	862	24,360.12	0.00
455	605286	同力日升	597	24,148.65	0.00
456	605080	浙江自然	374	23,894.86	0.00
457	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.00
458	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
459	003038	鑫铂股份	460	23,184.00	0.00
460	003040	楚天龙	1,101	22,636.56	0.00
461	300870	欧陆通	478	22,064.48	0.00
462	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.00
463	300873	海晨股份	774	21,880.98	0.00

464	001208	华菱线缆	1,754	21,784.68	0.00
465	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
466	003028	振邦智能	432	21,107.52	0.00
467	605020	永和股份	850	20,927.00	0.00
468	300872	天阳科技	1,568	20,901.44	0.00
469	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
470	605336	帅丰电器	701	20,714.55	0.00
471	003012	东鹏控股	2,278	19,909.72	0.00
472	605167	利柏特	2,471	19,595.03	0.00
473	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
474	605186	健麾信息	626	19,243.24	0.00
475	605077	华康股份	865	19,073.25	0.00
476	605296	神农集团	740	19,025.40	0.00
477	605377	华旺科技	1,050	18,805.50	0.00
478	605016	百龙创园	445	18,698.90	0.00
479	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.00
480	601686	友发集团	2,374	18,137.36	0.00
481	605268	王力安防	1,642	18,012.74	0.00
482	601528	瑞丰银行	2,230	17,973.80	0.00
483	603171	税友股份	637	17,823.26	0.00
484	003019	宸展光电	691	17,440.84	0.00
485	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
486	605208	永茂泰	1,081	17,112.23	0.00
487	300878	维康药业	722	16,902.02	0.00
488	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.00
489	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
490	603759	海天股份	1,656	16,742.16	0.00
491	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
492	605099	共创草坪	624	16,592.16	0.00
493	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
494	605060	联德股份	883	16,026.45	0.00
495	001205	盛航股份	808	15,998.40	0.00
496	300890	翔丰华	286	15,821.52	0.00
497	003037	三和管桩	1,274	15,581.02	0.00
498	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
499	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
500	605368	蓝天燃气	1,204	15,170.40	0.00
501	001216	华瓷股份	1,177	15,124.45	0.00
502	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
503	605068	明新旭腾	641	14,967.35	0.00
504	605169	洪通燃气	1,292	14,547.92	0.00

505	003029	吉大正元	716	14,534.80	0.00
506	605277	新亚电子	705	14,431.35	0.00
507	605183	确成股份	741	14,301.30	0.00
508	003020	立方制药	486	14,298.12	0.00
509	603230	内蒙新华	1,141	14,273.91	0.00
510	605056	咸亨国际	933	14,153.61	0.00
511	605133	嵘泰股份	618	14,139.84	0.00
512	003016	欣贺股份	1,681	14,120.40	0.00
513	300891	惠云钛业	1,143	13,796.01	0.00
514	601279	英利汽车	2,004	13,687.32	0.00
515	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
516	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
517	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
518	605389	长龄液压	498	13,341.42	0.00
519	003030	祖名股份	480	13,324.80	0.00
520	605179	一鸣食品	939	13,277.46	0.00
521	605151	西上海	722	12,822.72	0.00
522	003025	思进智能	619	12,807.11	0.00
523	605122	四方新材	703	12,654.00	0.00
524	300893	松原股份	621	12,544.20	0.00
525	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
526	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.00
527	605500	森林包装	762	12,428.22	0.00
528	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
529	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.00
530	003013	地铁设计	724	12,206.64	0.00
531	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
532	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
533	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
534	605007	五洲特纸	598	11,625.12	0.00
535	001207	联科科技	682	11,600.82	0.00
536	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
537	300864	南大环境	537	11,277.00	0.00
538	605098	行动教育	404	11,215.04	0.00
539	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.00
540	605005	合兴股份	634	10,993.56	0.00
541	300879	大叶股份	466	10,885.76	0.00
542	300908	仲景食品	285	10,724.55	0.00
543	605365	立达信	645	10,687.65	0.00
544	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
545	001206	依依股份	321	10,641.15	0.00

546	003015	日久光电	1,128	10,614.48	0.00
547	300868	杰美特	593	10,602.84	0.00
548	605058	澳弘电子	548	10,576.40	0.00
549	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
550	605378	野马电池	473	10,311.40	0.00
551	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
552	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
553	003006	百亚股份	804	9,921.36	0.00
554	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
555	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
556	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
557	003042	中农联合	546	9,789.78	0.00
558	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
559	603511	爱慕股份	553	9,660.91	0.00
560	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.00
561	003018	金富科技	1,027	9,499.75	0.00
562	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.00
563	300877	金春股份	569	9,422.64	0.00
564	605228	神通科技	1,217	9,407.41	0.00
565	605289	罗曼股份	474	9,375.72	0.00
566	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
567	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
568	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
569	605177	东亚药业	439	9,148.76	0.00
570	003010	若羽臣	562	9,132.50	0.00
571	003027	同兴环保	523	9,126.35	0.00
572	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
573	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
574	605086	龙高股份	443	8,877.72	0.00
575	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
576	605287	德才股份	349	8,798.29	0.00
577	605180	华生科技	499	8,677.61	0.00
578	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
579	605189	富春染织	423	8,493.84	0.00
580	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.00
581	003032	传智教育	586	8,409.10	0.00
582	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
583	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.00
584	605258	协和电子	340	8,211.00	0.00
585	300892	品渥食品	272	8,146.40	0.00
586	300882	万胜智能	572	8,145.28	0.00

587	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
588	003033	征和工业	301	8,066.80	0.00
589	605299	舒华体育	738	8,058.96	0.00
590	605303	园林股份	610	7,838.50	0.00
591	300876	蒙泰高新	350	7,836.50	0.00
592	001210	金房节能	311	7,790.55	0.00
593	605055	迎丰股份	1,146	7,666.74	0.00
594	603150	万朗磁塑	251	7,472.27	0.00
595	605155	西大门	490	7,217.70	0.00
596	605298	必得科技	508	6,908.80	0.00
597	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
598	300889	爱克股份	479	6,840.12	0.00
599	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
600	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
601	300881	盛德鑫泰	291	6,652.26	0.00
602	003023	彩虹集团	385	6,622.00	0.00
603	003041	真爱美家	419	6,532.21	0.00
604	003004	声迅股份	306	6,383.16	0.00
605	300886	华业香料	191	5,936.28	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603501	韦尔股份	1,443,496,136.63	5.27
2	300782	卓胜微	978,169,355.19	3.57
3	600745	闻泰科技	833,488,359.81	3.04
4	002371	北方华创	735,615,076.70	2.68
5	002268	卫士通	495,700,650.64	1.81
6	688126	沪硅产业	360,767,113.79	1.32
7	300655	晶瑞电材	315,680,406.87	1.15
8	603986	兆易创新	300,934,665.52	1.10
9	600703	三安光电	299,993,382.60	1.09
10	688012	中微公司	291,744,477.56	1.06
11	688082	盛美上海	227,116,942.56	0.83
12	688234	天岳先进	209,878,917.27	0.77
13	300223	北京君正	178,581,371.89	0.65
14	601127	赛力斯	171,233,445.26	0.62
15	688072	拓荆科技	127,279,469.09	0.46
16	688153	唯捷创芯	114,622,500.46	0.42

17	688981	中芯国际	10,393,399.75	0.04
18	688220	翱捷科技	2,035,524.34	0.01
19	688052	纳芯微	1,400,700.00	0.01
20	688327	云从科技	1,362,980.86	0.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603986	兆易创新	259,773,784.70	0.95
2	603501	韦尔股份	199,942,777.32	0.73
3	601127	赛力斯	144,796,404.10	0.53
4	300655	晶瑞电材	119,864,744.48	0.44
5	600703	三安光电	99,998,005.24	0.36
6	688981	中芯国际	49,999,891.05	0.18
7	688339	亿华通	43,225,108.21	0.16
8	600938	中国海油	508,334.10	0.00

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	7,120,642,286.20
卖出股票收入(成交)总额	918,109,049.20

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,321,379.90
2	应收清算款	79,884,601.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	320,683,876.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	401,889,857.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688126	沪硅产业	337,697,050.46	1.27	非公开发行锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,646,316	6,199.56	434,837,132.27	2.65%	15,971,166,907.56	97.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	17,688,036.30	0.1078%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年03月10日）基金份额总额	1,167,838,082.92
本报告期初基金份额总额	12,942,629,576.83
本报告期基金总申购份额	10,372,282,445.91
减：本报告期基金总赎回份额	6,908,907,982.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	16,406,004,039.83

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，王学明先生担任公司董事、赵忆波先生不再担任公司董事，于东升先生不再担任公司副总经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，因未按期完成境外子公司股权架构简化工作，中国证监会责令公司改正，公司将继续加紧推进。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	403,269,961.73	5.29%	286,843.33	5.09%	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期退租
长江证券	2	2,417,943,635.74	31.73%	1,733,212.97	30.78%	-

诚通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	329,974,809.75	4.33%	234,710.59	4.17%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	3,580,173,257.69	46.99%	2,549,188.95	45.27%	-
中银国际	1	887,809,373.77	11.65%	826,817.72	14.68%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 1 个证券公司 1 个交易单元：信达证券股份有限公司（1 个交易单元），

本报告期退租 1 个证券公司 1 个交易单元：长城证券股份有限公司（1 个交易单元）。

本报告期原新时代证券股份有限公司更名为诚通证券股份有限公司。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- （3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	99,976,222.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	诺安基金管理有限公司关于公司旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2022年01月01日
2	诺安成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第 1 期	基金管理人网站	2022年01月20日
3	诺安成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	《上海证券报》	2022年01月20日
4	诺安成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2022年01月20日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加普益基金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》	2022年01月21日
6	诺安成长混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022年01月24日
7	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 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》	2022年01月24日
8	诺安基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下公募基金的公告	《上海证券报》	2022年01月31日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资晶瑞电材非公开发行股票的公告	《上海证券报》	2022年02月08日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加第一创业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》	2022年02月10日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金投资沪硅产业非公开发行股票的公告	《上海证券报》	2022年03月09日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加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》	2022年03月10日
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通定投、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》	2022年03月15日
14	诺安基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	《上海证券报》	2022年03月18日
15	诺安基金管理有限公司关于开通平安银行借记卡直销网上交易业务并开展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》	2022年03月22日
16	诺安成长混合型证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022年03月31日
17	诺安基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、	2022年03月31日

		《证券日报》	
18	诺安基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月01日
19	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海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》	2022年04月08日
20	诺安基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月14日
21	诺安成长混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022年04月22日
22	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 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》	2022年04月22日
23	诺安基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《上海证券报》	2022年04月29日
24	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长城国瑞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》	2022年05月25日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富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》	2022年06月15日
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆享基金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》	2022年06月15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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-

个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20% 的情形，敬请投资者留意。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安成长股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安成长混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安成长混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安基金管理有限公司关于诺安成长股票型证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安成长混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

诺安基金管理有限公司
2022 年 08 月 31 日