

诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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的情况.....	61
§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.....	64
§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	67
§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	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金	
基金简称	诺德量化蓝筹	
基金主代码	005082	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 29 日	
基金管理人	诺德基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	195,655,336.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
下属分级基金的交易代码:	005082	005083
报告期末下属分级基金的份额总额	122,995.30 份	195,532,340.85 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	200120	518000
法定代表人	潘福祥	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺德基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 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

基金级别	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,393,722.02	20,412,269.96
本期利润	1,578,355.31	6,289,266.02
加权平均基金份额本期利润	0.1102	0.0314
本期加权平均净值利润率	9.82%	2.80%
本期基金份额净值增长率	1.22%	2.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	1,581.39	4,100,547.22
期末可供分配基金份额利润	0.0129	0.0210
期末基金资产净值	137,599.91	220,370,707.80
期末基金份额净值	1.1187	1.1270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.87%	12.70%

注：1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺德量化蓝筹 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.92%	0.55%	-1.13%	0.48%	0.21%	0.07%
过去三个月	1.43%	0.65%	2.64%	0.59%	-1.21%	0.06%
过去六个月	1.22%	0.82%	1.26%	0.79%	-0.04%	0.03%
过去一年	20.78%	0.79%	16.48%	0.80%	4.30%	-0.01%

过去三年	14.04%	0.79%	36.25%	0.81%	-22.21%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.87%	0.73%	27.92%	0.80%	-16.05%	-0.07%

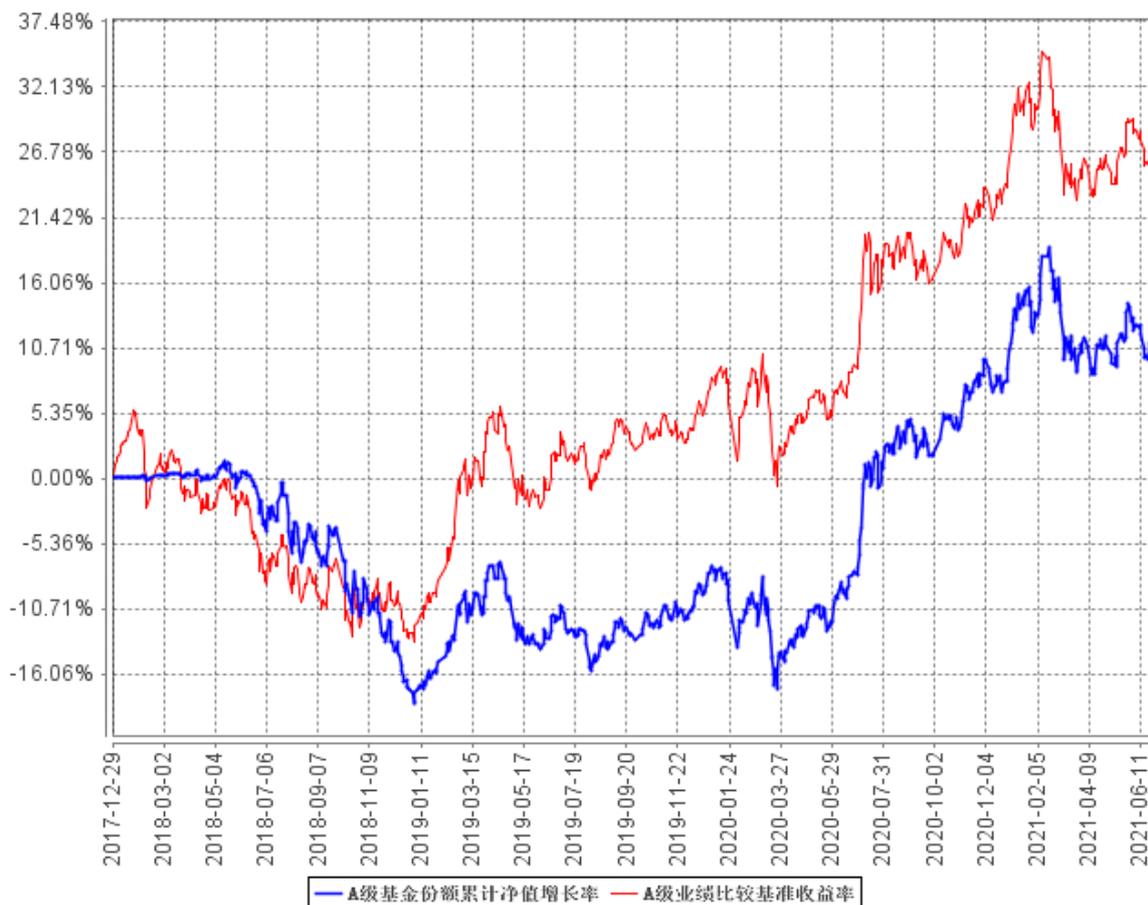
诺德量化蓝筹 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.92%	0.55%	-1.13%	0.48%	0.21%	0.07%
过去三个月	2.47%	0.63%	2.64%	0.59%	-0.17%	0.04%
过去六个月	2.38%	0.82%	1.26%	0.79%	1.12%	0.03%
过去一年	22.12%	0.79%	16.48%	0.80%	5.64%	-0.01%
过去三年	15.22%	0.79%	36.25%	0.81%	-21.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.70%	0.73%	27.92%	0.80%	-15.22%	-0.07%

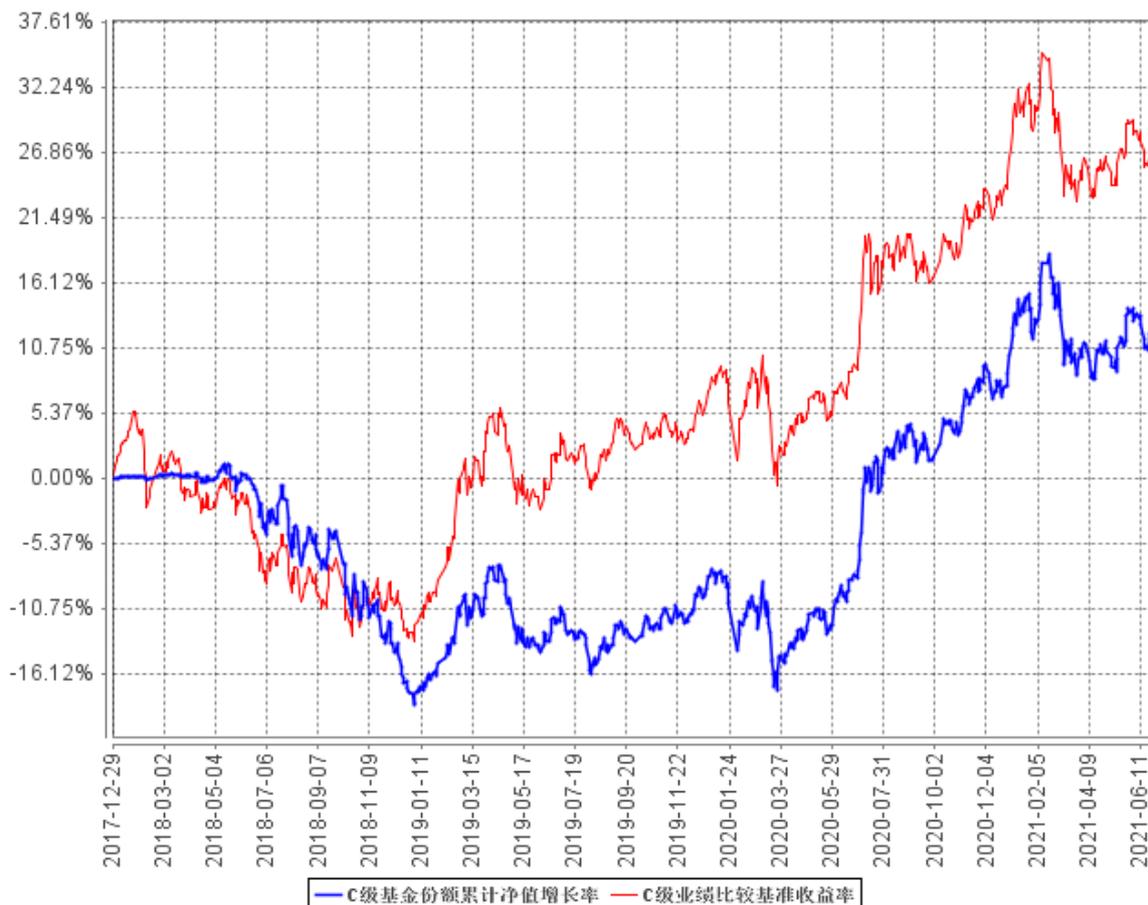
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*40%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同于 2017 年 12 月 29 日生效，图示时间段为 2017 年 12 月 29 日至 2021 年 6 月 30 日。本基金建仓期间自 2017 年 12 月 29 日至 2018 年 6 月 28 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾文宏	本基金基金经理以及诺德天富灵活配置混合型证券投资基金的基金经	2017 年 12 月 29 日	-	9	华中师范大学数量经济学硕士。2012 年 6 月至 2014 年 7 月于上海大智慧股份有限公司担任行业研究员兼产品经理，2014 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业部高级研究员, FOF 管理部投资经理等职务，具有基金从业资

	理				格。
--	---	--	--	--	----

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。此外，本基金管理人还建立了公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内宏观经济处于复苏磨底伴随结构转型升级的过程中。就股票二级市场而言，2021 年上半年具体表现为：上证综指涨幅 3.4%，上证 50 跌幅 3.9%，沪深 300 指数涨幅 0.24%，中证

500 指数涨幅 6.93%，创业板指数涨幅 17.22%，大小盘风格有所分化。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，诺德量化蓝筹 A 类份额净值为 1.1187 元，累计净值为 1.1187 元。本报告期份额净值增长率为 1.22%，同期业绩比较基准增长率为 1.26%。诺德量化蓝筹 C 类份额净值为 1.1270 元，累计净值为 1.1270 元。本报告期份额净值增长率为 2.38%，同期业绩比较基准增长率为 1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济整体依旧处于构筑底部的大背景中，从基本上，我们看出中国的宏观经济表现出了较好的韧性，疫情在中国得到了相对较好的控制，复工复产进展顺利，经济恢复情况较好。国际层面上来说，美国经济冲顶迹象明显，美联储全面走向货币宽松，财政刺激力度加大。我们认为在 2021 年下半年 A 股市场依旧存在不错的机会，将继续关注业绩反转和业绩超预期的公司，同时需要注意回避业绩存疑的个股。短期来看，我们认为或可继续做真正成长股之间的轮动，科创板和创业板在进一步调整之后依然有不错的机会，操作上注意规避业绩存疑的个股，关注真正能成长起来的公司，力争获取超额回报。全年来看，预计 2021 年量价齐升的周期子行业，以及资本市场改革背景下券商行业以及核心资产中业绩和估值匹配的龙头股票，其投资机会都有可能贯穿 2021 整年。

本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度，以低估值蓝筹配置为主，适当关注业绩逐步体现的成长公司，主要通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资研究部总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜

任能力和长期相关工作经历。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中：

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

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	32,337,636.69	18,832,464.56
结算备付金		5,599,284.51	32,762,798.94
存出保证金		42,065.26	67,206.23
交易性金融资产	6.4.7.2	177,735,597.97	182,697,820.93
其中：股票投资		177,735,597.97	182,697,820.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		23,419,169.88	26,162,096.11
应收利息	6.4.7.5	3,676.68	32,174.70
应收股利		-	-
应收申购款		5,431.41	13,258.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		239,142,862.40	260,567,820.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		18,329,412.92	184,749.25
应付管理人报酬		108,858.38	144,608.91
应付托管费		18,143.05	24,101.48
应付销售服务费		14,505.68	17,678.27
应付交易费用	6.4.7.7	74,374.49	23,733.40
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.17	180,000.34
负债合计		18,634,554.69	574,871.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	195,655,336.15	236,098,500.91
未分配利润	6.4.7.10	24,852,971.56	23,894,447.46
所有者权益合计		220,508,307.71	259,992,948.37
负债和所有者权益总计		239,142,862.40	260,567,820.02

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 195,655,336.15 份，其中诺德量化蓝筹 A 基金份额净值 1.1187 元，份额总额 122,995.30 份；诺德量化蓝筹 C 基金份额净值 1.1270 元，份额总额 195,532,340.85 份；

6.2 利润表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		9,103,412.02	2,861,482.95
1.利息收入		210,117.97	322,974.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	192,414.96	171,922.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,703.01	151,051.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,750,905.83	6,877,438.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,945,748.79	5,576,741.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,805,157.04	1,300,696.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,938,370.65	-4,339,719.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	80,758.87	789.77
减：二、费用		1,235,790.69	854,491.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	715,401.11	468,651.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	119,233.56	78,108.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	88,936.74	62,175.26
4. 交易费用	6.4.7.19	216,778.56	148,836.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	95,440.72	96,720.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,867,621.33	2,006,991.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,867,621.33	2,006,991.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	236,098,500.91	23,894,447.46	259,992,948.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,867,621.33	7,867,621.33
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）	-40,443,164.76	-6,909,097.23	-47,352,261.99
其中：1.基金申购款	189,580,031.22	24,196,083.36	213,776,114.58
2.基金赎回款	-230,023,195.98	-31,105,180.59	-261,128,376.57
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)	195,655,336.15	24,852,971.56	220,508,307.71
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	155,040,303.11	-12,510,778.98	142,529,524.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,006,991.55	2,006,991.55
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)	129,871,058.70	-11,389,974.10	118,481,084.60
其中：1.基金申购款	197,788,018.74	-18,220,794.79	179,567,223.95
2.基金赎回款	-67,916,960.04	6,830,820.69	-61,086,139.35
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)	284,911,361.81	-21,893,761.53	263,017,600.28

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：

罗凯

罗凯

高奇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1409号《关于准予诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期

限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 205,779,736.73 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,820,281.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 40,544.40 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 50%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：60%*沪深 300 指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率。

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》、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	32,337,636.69
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:	32,337,636.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	170,695,799.82	177,735,597.97	7,039,798.15
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	170,695,799.82	177,735,597.97	7,039,798.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,511.28
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	146.50
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	18.90
合计	3,676.68

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	74,374.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	74,374.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

诺德量化蓝筹 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	21,902,259.14	21,902,259.14
本期申购	18,465,344.42	18,465,344.42
本期赎回(以“-”号填列)	-40,244,608.26	-40,244,608.26
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	122,995.30	122,995.30

金额单位：人民币元

诺德量化蓝筹 C		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	214,196,241.77	214,196,241.77
本期申购	171,114,686.80	171,114,686.80
本期赎回(以“-”号填列)	-189,778,587.72	-189,778,587.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	195,532,340.85	195,532,340.85

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

诺德量化蓝筹 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,705,611.50	4,009,112.43	2,303,500.93
本期利润	1,393,722.02	184,633.29	1,578,355.31
本期基金份额交易产生的变动数	313,470.87	-4,180,722.50	-3,867,251.63
其中：基金申购款	-893,122.70	2,698,827.91	1,805,705.21
基金赎回款	1,206,593.57	-6,879,550.41	-5,672,956.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,581.39	13,023.22	14,604.61

单位：人民币元

诺德量化蓝筹 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-17,495,232.67	39,086,179.20	21,590,946.53
本期利润	20,412,269.96	-14,123,003.94	6,289,266.02
本期基金份额交易产生的变动数	1,183,509.93	-4,225,355.53	-3,041,845.60
其中：基金申购款	-5,912,541.42	28,302,919.57	22,390,378.15
基金赎回款	7,096,051.35	-32,528,275.10	-25,432,223.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,100,547.22	20,737,819.73	24,838,366.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	69,509.82
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	116,795.69
其他	6,109.45
合计	192,414.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	71,907,915.31
减：卖出股票成本总额	50,962,166.52
买卖股票差价收入	20,945,748.79

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,805,157.04
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	1,805,157.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,938,370.65
——股票投资	-13,938,370.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-13,938,370.65

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	80,679.04
转换费收入	79.83
合计	80,758.87

注：1. 本基金 A 类基金份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对持续持有基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额

计入基金财产；对持续持有基金份额长于 30 日（含）但少于 90 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有基金份额长于 90 日（含）但少于 180 日（含）的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产。

2. 本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3. 本基金的转换费用由申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	216,778.56
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	216,778.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,180.57
合计	95,440.72

6.4.7.21 分部报告

不适用。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内未发生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
诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
清华控股有限公司（“清华控股”）	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理（北京）有限公司（“宜信惠民”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	715,401.11	468,651.25
其中：支付销售机构的客户维护费	6,457.48	176.85

注：支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	119,233.56	78,108.51

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	合计
诺德基金	-	87,238.74	87,238.74
合计	-	87,238.74	87,238.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C	合计
诺德基金	-	62,127.35	62,127.35
合计	-	62,127.35	62,127.35

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

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	517,241.38
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	517,241.38
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.18%

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

本报告期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

本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保存的银行存款及利息收入。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
688083	中望 软件	2021年 3月4日	2021 年9月 13日	新股流 通受限	150.50	524.08	519	78,109.50	271,997.52	-
688161	威高 骨科	2021年 6月23 日	2021 年12 月30 日	新股流 通受限	36.22	82.27	1,337	48,426.14	109,994.99	-
688639	华恒 生物	2021年 4月14 日	2021 年10 月22	新股流 通受限	23.16	42.28	2,216	51,322.56	93,692.48	-

			日							
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股流通受限	5.44	7.26	12,468	67,825.92	90,517.68	-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股流通受限	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	新股流通受限	50.05	72.10	1,156	57,857.80	83,347.60	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	1,653	64,219.05	64,219.05	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,148	47,170.08	47,170.08	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

		日	6日							
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	167	7,904.11	42,077.32	-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	207	5,853.96	23,951.97	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	255	8,471.10	22,312.50	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	677	8,489.58	18,881.53	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	350	7,458.50	17,479.00	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文	2021年	2021	新股流	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

	电能	4月19日	年10月27日	通受限						
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	418	10,320.42	13,254.78	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

			日							
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

		日	12 日							
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈	2021 年	2021	新股流	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

	仕	6月4日	年12月16日	通受限						
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	311	7,650.60	50,693.00	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	拟披露重大事項	5.59	2021年7月6日	6.15	38,500	337,260.00	215,215.00	-

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

本报告期末本基金未持有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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：（1）决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组

成；(2) 执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3) 监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、稽核风控部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

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

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具有托管资质的招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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

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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	32,337,636.69	-	-	-	-	-	32,337,636.69
结算备付金	5,599,284.51	-	-	-	-	-	5,599,284.51
存出保证金	42,065.26	-	-	-	-	-	42,065.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	177,735,597.97	177,735,597.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-	23,419,169.88	23,419,169.88
应收利息	-	-	-	-	-	3,676.68	3,676.68
应收申购款	-	-	-	-	-	5,431.41	5,431.41
资产总计	37,978,986.46	-	-	-	-	201,163,875.94	239,142,862.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,329,412.92	18,329,412.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108,858.38	108,858.38
应付托管费	-	-	-	-	-	18,143.05	18,143.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,505.68	14,505.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	74,374.49	74,374.49
其他负债	-	-	-	-	-	89,260.17	89,260.17
负债总计	-	-	-	-	-	18,634,554.69	18,634,554.69
利率敏感度缺口	37,978,986.46	-	-	-	-	182,529,321.25	220,508,307.71
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	18,832,464.56	-	-	-	-	-	18,832,464.56
结算备付金	32,762,798.94	-	-	-	-	-	32,762,798.94

存出保证金	67,206.23	-	-	-	-	67,206.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-182,697,820.93	182,697,820.93
应收证券清算款	-	-	-	-	26,162,096.11	26,162,096.11
应收利息	-	-	-	-	32,174.70	32,174.70
应收申购款	-	-	-	-	13,258.55	13,258.55
资产总计	51,662,469.73	-	-	-	-208,905,350.29	260,567,820.02
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	184,749.25	184,749.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	144,608.91	144,608.91
应付托管费	-	-	-	-	24,101.48	24,101.48
应付销售服务费	-	-	-	-	17,678.27	17,678.27
应付交易费用	-	-	-	-	23,733.40	23,733.40
其他负债	-	-	-	-	180,000.34	180,000.34
负债总计	-	-	-	-	574,871.65	574,871.65
利率敏感度缺口	51,662,469.73	-	-	-	-208,330,478.64	259,992,948.37

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的 50%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	177,735,597.97	80.60	182,697,820.93	70.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	177,735,597.97	80.60	182,697,820.93	70.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	6,508,302.70	7,361,700.33
沪深 300 指数下降 5%	-6,508,302.70	-7,361,700.33	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	177,735,597.97	74.32
	其中：股票	177,735,597.97	74.32
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	37,936,921.20	15.86
8	其他各项资产	23,470,343.23	9.81
9	合计	239,142,862.40	100.00

7.2 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

金额单位：人民币元

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	4,531,315.28	2.05
B	采矿业	5,957,591.80	2.70
C	制造业	82,070,014.90	37.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,763,518.39	0.80
E	建筑业	4,169,379.37	1.89
F	批发和零售业	2,353,225.58	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,999,625.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,923,068.36	3.59
J	金融业	55,824,699.60	25.32
K	房地产业	5,860,210.00	2.66
L	租赁和商务服务业	532,200.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	936,000.00	0.42

N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	154,586.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,529,005.36	0.69
R	文化、体育和娱乐业	2,086,720.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	177,735,597.97	80.60

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,200	8,638,140.00	3.92
2	600030	中信证券	327,400	8,165,356.00	3.70
3	601318	中国平安	96,700	6,215,876.00	2.82
4	600036	招商银行	100,000	5,419,000.00	2.46
5	000333	美的集团	59,500	4,246,515.00	1.93
6	000651	格力电器	70,000	3,647,000.00	1.65
7	000858	五粮液	11,900	3,544,891.00	1.61
8	601166	兴业银行	152,100	3,125,655.00	1.42
9	000001	平安银行	133,100	3,010,722.00	1.37
10	601601	中国太保	100,100	2,899,897.00	1.32
11	600276	恒瑞医药	40,344	2,742,181.68	1.24
12	601668	中国建筑	569,600	2,648,640.00	1.20
13	000002	万科 A	110,000	2,619,100.00	1.19
14	002415	海康威视	36,500	2,354,250.00	1.07
15	000063	中兴通讯	66,000	2,193,180.00	0.99
16	600309	万华化学	20,000	2,176,400.00	0.99
17	300059	东方财富	64,200	2,105,118.00	0.95
18	601288	农业银行	690,000	2,090,700.00	0.95
19	600887	伊利股份	56,700	2,088,261.00	0.95
20	300408	三环集团	48,200	2,044,644.00	0.93
21	601328	交通银行	409,200	2,005,080.00	0.91
22	601398	工商银行	386,700	1,999,239.00	0.91
23	000603	盛达资源	150,000	1,888,500.00	0.86

24	002237	恒邦股份	160,000	1,838,400.00	0.83
25	600900	长江电力	84,100	1,735,824.00	0.79
26	600031	三一重工	59,100	1,718,037.00	0.78
27	300761	立华股份	50,000	1,656,500.00	0.75
28	600837	海通证券	139,800	1,607,700.00	0.73
29	601336	新华保险	35,000	1,606,850.00	0.73
30	600016	民生银行	341,500	1,506,015.00	0.68
31	600048	保利地产	124,800	1,502,592.00	0.68
32	601012	隆基股份	16,800	1,492,512.00	0.68
33	002475	立讯精密	31,800	1,462,800.00	0.66
34	002036	联创电子	100,000	1,315,000.00	0.60
35	000725	京东方 A	200,000	1,248,000.00	0.57
36	600000	浦发银行	120,300	1,203,000.00	0.55
37	601108	财通证券	110,000	1,153,900.00	0.52
38	002714	牧原股份	18,900	1,149,498.00	0.52
39	601988	中国银行	372,800	1,148,224.00	0.52
40	601688	华泰证券	71,000	1,121,800.00	0.51
41	300124	汇川技术	14,850	1,102,761.00	0.50
42	603337	杰克股份	40,000	1,069,200.00	0.48
43	601766	中国中车	175,800	1,068,864.00	0.48
44	600893	航发动力	20,000	1,063,800.00	0.48
45	600028	中国石化	242,200	1,055,992.00	0.48
46	603214	爱婴室	44,700	1,051,344.00	0.48
47	002601	龙鳞佰利	30,000	1,037,400.00	0.47
48	603688	石英股份	43,100	1,012,850.00	0.46
49	002142	宁波银行	25,800	1,005,426.00	0.46
50	600958	东方证券	100,000	999,000.00	0.45
51	601088	中国神华	48,300	942,816.00	0.43
52	300284	苏交科	160,000	936,000.00	0.42
53	000100	TCL 科技	121,100	926,415.00	0.42
54	600585	海螺水泥	22,500	923,625.00	0.42
55	600690	海尔智家	35,500	919,805.00	0.42
56	300133	华策影视	150,000	888,000.00	0.40
56	600572	康恩贝	200,000	888,000.00	0.40
57	601211	国泰君安	50,500	865,570.00	0.39
58	000338	潍柴动力	47,900	855,973.00	0.39
59	603533	掌阅科技	30,000	855,000.00	0.39
60	300347	泰格医药	4,400	850,520.00	0.39
61	600019	宝钢股份	110,600	844,984.00	0.38

62	600104	上汽集团	38,300	841,451.00	0.38
63	002673	西部证券	100,000	825,000.00	0.37
64	300348	长亮科技	45,000	823,500.00	0.37
65	600637	东方明珠	100,000	819,000.00	0.37
66	601857	中国石油	154,500	817,305.00	0.37
67	600703	三安光电	25,500	817,275.00	0.37
68	002311	海大集团	10,000	816,000.00	0.37
69	601939	建设银行	120,600	801,990.00	0.36
70	002241	歌尔股份	18,600	794,964.00	0.36
71	300381	溢多利	80,000	782,400.00	0.35
72	600588	用友网络	23,400	778,284.00	0.35
73	300122	智飞生物	4,100	765,593.00	0.35
74	300182	捷成股份	150,000	748,500.00	0.34
75	600926	杭州银行	50,000	737,500.00	0.33
76	002460	赣锋锂业	6,000	726,540.00	0.33
77	002299	圣农发展	30,000	716,400.00	0.32
78	600196	复星医药	9,900	714,087.00	0.32
79	601390	中国中铁	130,000	681,200.00	0.31
80	002352	顺丰控股	10,000	677,000.00	0.31
81	300498	温氏股份	47,100	676,827.00	0.31
82	002153	石基信息	28,000	658,280.00	0.30
83	300224	正海磁材	60,000	652,200.00	0.30
84	002990	盛视科技	20,000	647,200.00	0.29
85	601818	光大银行	169,900	642,222.00	0.29
86	603986	兆易创新	3,360	631,344.00	0.29
87	600660	福耀玻璃	11,300	631,105.00	0.29
88	002304	洋河股份	3,000	621,600.00	0.28
89	601186	中国铁建	83,000	616,690.00	0.28
90	600738	丽尚国潮	100,000	611,000.00	0.28
91	603993	洛阳钼业	116,700	602,172.00	0.27
92	688196	卓越新能	9,965	589,728.70	0.27
93	002736	国信证券	54,508	585,961.00	0.27
94	601717	郑煤机	50,000	581,500.00	0.26
95	002171	楚江新材	66,400	579,672.00	0.26
96	000538	云南白药	4,800	555,456.00	0.25
97	601628	中国人寿	16,100	545,629.00	0.25
98	300454	深信服	2,000	518,960.00	0.24
99	000661	长春高新	1,300	503,100.00	0.23
100	601899	紫金矿业	51,900	502,911.00	0.23

101	300666	江丰电子	10,000	498,700.00	0.23
102	600009	上海机场	10,100	486,113.00	0.22
103	002493	荣盛石化	27,450	474,061.50	0.21
104	002027	分众传媒	50,000	470,500.00	0.21
105	000625	长安汽车	17,900	470,412.00	0.21
106	300015	爱尔眼科	6,612	469,319.76	0.21
107	000157	中联重科	50,000	462,000.00	0.21
108	002600	领益智造	50,000	459,500.00	0.21
109	600362	江西铜业	20,000	447,600.00	0.20
110	000776	广发证券	29,400	445,116.00	0.20
111	300003	乐普医疗	13,700	440,044.00	0.20
112	002624	完美世界	18,300	437,553.00	0.20
113	600438	通威股份	10,000	432,700.00	0.20
114	600050	中国联通	98,000	423,360.00	0.19
115	601111	中国国航	54,000	420,120.00	0.19
116	000166	申万宏源	85,800	401,544.00	0.18
117	002410	广联达	5,800	395,560.00	0.18
118	002179	中航光电	5,000	395,100.00	0.18
119	601989	中国重工	95,600	393,872.00	0.18
120	000786	北新建材	10,000	392,500.00	0.18
121	601901	方正证券	41,800	391,248.00	0.18
122	000768	中航西飞	14,200	373,176.00	0.17
123	000963	华东医药	8,000	368,080.00	0.17
124	300203	聚光科技	30,000	361,200.00	0.16
125	002157	正邦科技	30,000	358,500.00	0.16
126	001979	招商蛇口	31,400	343,830.00	0.16
127	002007	华兰生物	9,300	341,124.00	0.15
128	002385	大北农	50,000	340,000.00	0.15
129	002236	大华股份	15,900	335,490.00	0.15
130	002314	南山控股	100,000	333,000.00	0.15
131	002202	金风科技	27,314	332,138.24	0.15
132	002294	信立泰	10,000	329,000.00	0.15
133	000998	隆平高科	20,000	320,800.00	0.15
134	300031	宝通科技	20,000	315,200.00	0.14
135	002008	大族激光	7,800	315,042.00	0.14
136	000425	徐工机械	49,100	312,767.00	0.14
137	601138	工业富联	25,000	310,250.00	0.14
138	000623	吉林敖东	20,000	309,800.00	0.14
139	000069	华侨城 A	41,500	308,760.00	0.14

140	000876	新希望	20,800	305,136.00	0.14
141	000636	风华高科	10,000	302,200.00	0.14
142	002043	兔宝宝	30,000	295,800.00	0.13
143	300144	宋城演艺	17,400	292,320.00	0.13
144	000596	古井贡酒	1,200	287,400.00	0.13
145	002508	老板电器	6,168	286,812.00	0.13
146	000783	长江证券	38,300	280,356.00	0.13
147	000895	双汇发展	8,800	279,840.00	0.13
148	688083	中望软件	519	271,997.52	0.12
149	002351	漫步者	20,000	270,800.00	0.12
150	300433	蓝思科技	8,600	252,926.00	0.11
151	600029	南方航空	42,000	252,840.00	0.11
152	300451	创业慧康	26,000	229,840.00	0.10
153	300033	同花顺	2,000	225,560.00	0.10
154	002368	太极股份	11,060	221,863.60	0.10
155	600111	北方稀土	10,600	219,420.00	0.10
156	000789	万年青	18,900	216,216.00	0.10
157	002024	苏宁易购	38,500	215,215.00	0.10
158	000728	国元证券	26,650	212,400.50	0.10
159	002044	美年健康	22,960	209,165.60	0.09
160	300136	信维通信	6,700	206,896.00	0.09
161	600522	中天科技	20,000	200,000.00	0.09
162	002555	三七互娱	8,300	199,366.00	0.09
163	600340	华夏幸福	37,700	197,548.00	0.09
164	601800	中国交建	29,400	190,512.00	0.09
165	000703	恒逸石化	15,700	187,615.00	0.09
166	603160	汇顶科技	1,400	181,482.00	0.08
167	002100	天康生物	20,000	178,200.00	0.08
168	002422	科伦药业	8,800	175,560.00	0.08
169	603019	中科曙光	6,000	165,660.00	0.08
170	600183	生益科技	7,000	163,870.00	0.07
171	600867	通化东宝	13,500	161,190.00	0.07
172	002739	万达电影	10,000	157,900.00	0.07
173	002798	帝欧家居	10,000	155,800.00	0.07
174	002916	深南电路	1,400	155,582.00	0.07
175	002607	中公教育	7,400	154,586.00	0.07
176	002252	上海莱士	20,200	151,298.00	0.07
177	600606	绿地控股	26,000	141,700.00	0.06
178	600547	山东黄金	7,140	137,230.80	0.06

179	600498	烽火通信	7,300	135,999.00	0.06
180	002120	韵达股份	9,400	127,182.00	0.06
181	601066	中信建投	4,000	125,720.00	0.06
182	000656	金科股份	21,200	122,748.00	0.06
183	300017	网宿科技	20,000	117,000.00	0.05
184	688161	威高骨科	1,337	109,994.99	0.05
185	601319	中国人保	18,300	108,519.00	0.05
186	000709	河钢股份	43,300	106,518.00	0.05
187	002032	苏泊尔	1,600	102,064.00	0.05
188	000961	中南建设	17,100	101,232.00	0.05
189	600737	中粮糖业	10,000	100,100.00	0.05
190	002146	荣盛发展	17,500	98,700.00	0.04
191	000723	美锦能源	12,800	96,768.00	0.04
192	688639	华恒生物	2,216	93,692.48	0.04
193	000671	阳光城	17,500	91,000.00	0.04
194	688660	电气风电	12,468	90,517.68	0.04
195	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.04
196	002841	视源股份	700	87,003.00	0.04
197	002531	天顺风能	10,000	86,500.00	0.04
198	002938	鹏鼎控股	2,400	86,112.00	0.04
199	688109	品茗股份	1,156	83,347.60	0.04
200	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.04
201	002558	巨人网络	6,000	79,800.00	0.04
202	000627	天茂集团	19,300	69,866.00	0.03
203	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
204	688499	利元亨	1,653	64,219.05	0.03
205	002707	众信旅游	10,000	61,700.00	0.03
206	300497	富祥药业	4,800	60,432.00	0.03
207	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.03
208	300919	中伟股份	311	50,693.00	0.02
209	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
210	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.02
211	002773	康弘药业	2,100	48,573.00	0.02
212	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.02
213	688087	英科再生	2,148	47,170.08	0.02
214	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
215	300957	贝泰妮	167	42,077.32	0.02
216	002945	华林证券	2,900	40,078.00	0.02
217	002939	长城证券	3,500	38,955.00	0.02

218	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.02
219	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
220	601236	红塔证券	2,100	28,476.00	0.01
221	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
222	002468	申通快递	3,500	26,670.00	0.01
223	002958	青农商行	5,800	24,824.00	0.01
224	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
225	300973	立高食品	207	23,951.97	0.01
226	300979	华利集团	255	22,312.50	0.01
227	600089	特变电工	1,700	21,845.00	0.01
228	301009	可靠股份	677	18,881.53	0.01
229	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
230	300941	创识科技	350	17,479.00	0.01
231	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
232	601233	桐昆股份	640	15,417.60	0.01
233	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
234	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
235	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
236	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
237	300932	三友联众	418	13,254.78	0.01
238	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
239	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
240	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
241	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.01
242	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
243	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
244	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
245	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
246	601225	陕西煤业	900	10,665.00	0.00
247	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
248	601600	中国铝业	1,900	10,070.00	0.00
249	600886	国投电力	1,000	9,610.00	0.00
250	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
251	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
252	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
253	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
254	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
255	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
256	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00

257	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
258	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
259	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
260	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
261	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
262	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
263	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
264	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
265	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
266	600741	华域汽车	300	7,881.00	0.00
267	601669	中国电建	1,800	6,966.00	0.00
268	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
269	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
270	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
271	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
272	601607	上海医药	300	6,339.00	0.00
273	600115	中国东航	1,200	6,096.00	0.00
274	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
275	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
276	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
277	600153	建发股份	700	5,670.00	0.00
278	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
279	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
280	600011	华能国际	1,200	5,064.00	0.00
281	600643	爱建集团	700	4,886.00	0.00
282	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
283	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
284	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
285	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
286	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
287	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
288	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
289	601727	上海电气	900	3,816.00	0.00
290	601333	广深铁路	1,700	3,604.00	0.00
291	600352	浙江龙盛	200	2,748.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	6,169,300.00	2.37
2	600216	浙江医药	2,198,800.00	0.85
3	300567	精测电子	2,128,000.00	0.82
4	000603	盛达资源	2,071,000.00	0.80
5	000776	广发证券	1,558,000.00	0.60
6	300408	三环集团	1,494,300.00	0.57
7	000858	五粮液	1,468,740.00	0.56
8	002385	大北农	1,430,500.00	0.55
9	002460	赣锋锂业	1,242,000.00	0.48
10	603337	杰克股份	1,201,655.00	0.46
11	601108	财通证券	1,191,000.00	0.46
12	603214	爱婴室	1,094,990.00	0.42
13	002036	联创电子	1,087,602.00	0.42
14	002050	三花智控	1,046,000.00	0.40
15	688196	卓越新能	1,018,962.38	0.39
16	002601	龙佰集团	1,004,500.00	0.39
17	601668	中国建筑	986,000.00	0.38
18	600958	东方证券	971,000.00	0.37
19	300158	振东制药	964,000.00	0.37
20	600872	中炬高新	940,000.00	0.36

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

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	601166	兴业银行	2,801,858.00	1.08
2	600216	浙江医药	2,424,377.48	0.93
3	002920	德赛西威	2,289,000.00	0.88
4	300567	精测电子	2,207,200.00	0.85
5	600519	贵州茅台	2,117,926.00	0.81

6	000568	泸州老窖	1,815,040.00	0.70
7	601318	中国平安	1,797,015.79	0.69
8	000776	广发证券	1,578,000.00	0.61
9	002050	三花智控	1,444,097.94	0.56
10	601211	国泰君安	1,402,841.00	0.54
11	002532	天山铝业	1,180,100.00	0.45
12	603259	药明康德	1,171,240.00	0.45
13	000661	长春高新	1,158,984.00	0.45
14	300036	超图软件	1,154,111.00	0.44
15	002385	大北农	1,045,000.00	0.40
16	002636	金安国纪	1,022,652.30	0.39
17	600872	中炬高新	1,005,600.00	0.39
18	300158	振东制药	988,000.00	0.38
19	300395	菲利华	960,759.24	0.37
20	603444	吉比特	913,995.00	0.35

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

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	59,938,314.21
卖出股票收入（成交）总额	71,907,915.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，招商银行（600036）的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）、兴业银行（601166）的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）、平安银行（000001）的发行主体平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）存在被监管公开处罚的情形。

1、招商银行（600036）

根据 2021 年 5 月 17 日的行政处罚决定，因招商银行：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权

设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息，被中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元。

2、兴业银行（601166）

根据 2020 年 9 月 4 日的行政处罚决定，因兴业银行：1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务，被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

根据 2020 年 8 月 31 日的行政处罚决定，因兴业银行：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保，被中国银行保险监督管理委员会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

3、平安银行（000001）

根据 2021 年 5 月 28 日的行政处罚决定，因平安银行：利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品，被中国银行保险监督管理委员会云南监管局罚款人民币 210 万元。

根据 2020 年 10 月 16 日的行政处罚决定，因平安银行：贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局合计罚款人民币 100 万元。

对招商银行、兴业银行、平安银行的投资决策程序的说明：

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

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	42,065.26
2	应收证券清算款	23,419,169.88
3	应收股利	-
4	应收利息	3,676.68
5	应收申购款	5,431.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,470,343.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
诺德量化蓝筹 A	631	194.92	-	-	122,995.30	100.00%
诺德量化蓝筹 C	1,424	137,312.04	194,953,795.08	99.70%	578,545.77	0.30%
合计	2,055	95,209.41	194,953,795.08	99.64%	701,541.07	0.36%

8.2 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的从业人员未持有本基金。

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	诺德量化蓝筹 A	0
	诺德量化蓝筹 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺德量化蓝筹 A	0
	诺德量化蓝筹 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 29 日）基金份额总额	205,820,281.13	195,065,602.49
本报告期期初基金份额总额	21,902,259.14	214,196,241.77
本报告期基金总申购份额	18,465,344.42	171,114,686.80
减：本报告期基金总赎回份额	40,244,608.26	189,778,587.72
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,995.30	195,532,340.85

注：总申购份额包含转换入份额；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

本报告期内无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

(1) 本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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

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、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内继续聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2021 年度的基金审计机构，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 4 年的审计服务。

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

本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情形。

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	
财信证券	2	82,632,145.86	65.77%	76,955.44	65.77%	-
光大证券	2	43,008,660.33	34.23%	40,053.90	34.23%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

(1) 公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全、在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财信证券	-	-	31,000,000.00	67.39%	-	-
光大证券	-	-	15,000,000.00	32.61%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
2	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
3	诺德基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 2 月 8 日
4	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 10 日
5	关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金恢复大额申	中国证券报、指定互联网网站	2021 年 3 月 23 日

	购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告		
6	诺德基金管理有限公司关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021 年 3 月 26 日
7	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2020 年年度报告	指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日
8	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日
9	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
10	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
11	诺德基金管理有限公司关于调整微信网上直销业务优惠费率率的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
12	诺德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 24 日
13	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国人寿保险股份有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 18 日
14	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富（上海）基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 29 日
15	关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021 年 6 月 18 日
16	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京虹点基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 19 日

	公告		
17	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京度小满基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日
18	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海爱建基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

§ 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	1	20210101 - 20210224	67,425,180.05	-	67,425,180.05	0.00	0.00%
	2	20210225 - 20210405	-	67,743,616.47	45,170,000.00	22,573,616.47	11.54%
	3	20210311 - 20210530	32,697,547.68	18,225,644.76	50,923,192.44	0.00	0.00%
	4	20210408 - 20210412; 20210416 - 20210419; 20210602 - 20210620	38,395,276.51	-	-	38,395,276.51	19.62%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、基金净值大幅波动的风险

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

2、赎回申请延期办理的风险

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

3、基金投资策略难以实现的风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：<http://www.nuodefund.com>。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

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

诺德基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日