

诺安价值增长混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安价值增长混合型证券投资基金
基金简称	诺安价值增长混合
基金主代码	320005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月21日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	728,547,329.25份
基金合同存续期	不定期

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

2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国GDP的高速增长和资本市场的快速增长,发掘价值低估和能够长期持续增长的优秀企业,获得稳定的中长期资本投资收益。
投资策略	在资产配置方面,根据国内外宏观经济形势、资本和货币市场的走势,采取自上而下的方法,合理调整基金资产中股票投资的比例,并附之以适当的债券和现金投资;在股票选择方面,采取自下而上的方法精选股票;在债券选择方面,通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线,积极调整债券组合的久期结构,运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于中高风险、中高收益的基金品种。

注：自2018年1月22日起，本基金业绩比较基准由“80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数”变更为“沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐斌
	联系电话	0755-83026688
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95588
传真	0755-83026677	(010) 66105798
注册地址	深圳市深南大道4013号兴业 银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街 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	秦维舟	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦 19-20层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	234,593,724.85
本期利润	90,873,240.43
加权平均基金份额本期利润	0.1188

本期加权平均净值利润率	6.51%
本期基金份额净值增长率	6.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	659,725,181.62
期末可供分配基金份额利润	0.9055
期末基金资产净值	1,388,272,510.87
期末基金份额净值	1.9055
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	286.58%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.66%	1.19%	-1.57%	0.64%	0.91%	0.55%
过去三个月	12.02%	1.23%	3.09%	0.78%	8.93%	0.45%
过去六个月	6.23%	1.75%	0.82%	1.05%	5.41%	0.70%
过去一年	28.13%	1.63%	20.99%	1.07%	7.14%	0.56%
过去三年	74.53%	1.52%	43.03%	1.09%	31.50%	0.43%
自基金合同生效起至今	286.58%	1.52%	200.46%	1.38%	86.12%	0.14%

注：自2018年1月22日起，本基金业绩比较基准由“80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数”变更为“沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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

诺安价值增长混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理62只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、

诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深300指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

王创练	本基金 基金经理	2019年01月22日	-	25年	博士，具有基金从业资格。曾先后任职于特区证券研究所、南方证券研究所、长城基金管理有限公司，2008年3月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部副总监，现任首席策略师（总助级）兼研究部总监。2017年3月至2018年6月任诺安平衡证券投资基金基金经理，2018年6月至2020年5月任诺安成长混合型证券投资基金基金经理。2015年3月起任诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理，2018年3月起任诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任诺安价值增长混合型证券投资基金基金经理，2020年5月起任诺安研究优选混合型证券投资基金基金经理。
-----	-------------	-------------	---	-----	--

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安价值增长混合型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

截至二季度末，本基金重点关注消费和周期行业，对于优质的个股亦有布局；基金仓位处于均衡位置。

回顾二季度，从宏观流动性的层面，政策为了支持疫情下实体经济发展，守住基本盘，货币政策确实宽松；从微观层面，公募、外资、杠杆资金以及其他融资途径的资金入市，触发了二季度绝大部分宽基指数的上行；而其中以高景气、业绩确定性较高的赛道尤为突出。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安价值增长混合基金份额净值为1.9055元；本报告期内，基金份额净值增长率为6.23%，同期业绩比较基准收益率为0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，下半年经济状况或面临一定转折。上半年国内实行中性稳健的货币政策导致信用在一定程度上有所收缩，所以在流动性驱动和经济增长前景不明朗的背景下，中小市值的公司表现较优。下半年的经济走势有望保持平稳。社融环比增速在2021年上半年平稳，决定了下半年的经济走势是大体平稳的基调。

从全球的情况来看，经济缓慢修复，货币政策或逐步收紧。当然鉴于全球疫情的复杂性，经济回到正常水平仍旧是一个较为漫长的过程，与此同时，货币政策回归正常也是一个缓慢的过程，还很难过。而在这样一个流动性相对宽裕、资本急切寻觅高回报领域的环境下，行业的竞争或许会愈演愈烈。这要求投资人在已知的高景气行业研究上更加深入，同时对于其他赛道的研究要保持足够的广度和警觉。由此可以判断，未来几年预期回报率下降可能是难以避免的。

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

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，诺安价值增长混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安价值增长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申

购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安价值增长混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：诺安价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	172,007,989.58	161,948,605.13
结算备付金		781,400.95	1,010,836.02
存出保证金		222,334.21	155,767.77
交易性金融资产	6.4.7.2	1,221,057,090.03	1,375,362,906.53
其中：股票投资		1,221,057,090.03	1,375,362,906.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		158,433.70	627,713.75
应收利息	6.4.7.5	16,277.86	14,001.81
应收股利		-	-

应收申购款		92,316.05	94,079.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,394,335,842.38	1,539,213,910.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06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		-	9,985,438.00
应付赎回款		2,932,051.14	7,761,954.56
应付管理人报酬		1,713,162.50	1,840,985.87
应付托管费		285,527.10	306,830.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	598,197.47	563,479.61
应交税费		419,101.00	419,101.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,292.30	227,884.31
负债合计		6,063,331.51	21,105,674.32
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	728,547,329.25	846,350,583.70
未分配利润	6.4.7.10	659,725,181.62	671,757,652.00
所有者权益合计		1,388,272,510.87	1,518,108,235.70
负债和所有者权益总计		1,394,335,842.38	1,539,213,910.02

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.9055元，基金份额总额728,547,329.25份。

6.2 利润表

会计主体：诺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
一、收入		105,709,295.50	330,273,543.74
1. 利息收入		245,734.64	496,389.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	245,734.64	425,283.20
债券利息收入		-	2,719.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	68,386.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		249,130,714.74	165,096,703.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	238,204,161.95	154,533,080.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1,115,607.83
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	10,926,552.79	9,448,014.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-143,720,484.42	164,252,673.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	53,330.54	427,777.55

”号填列)			
减：二、费用		14,836,055.07	16,565,442.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,428,926.43	11,092,927.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,738,154.42	1,848,821.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,546,144.28	3,519,941.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	9.79
7. 其他费用	6.4.7.20	122,829.94	103,741.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,873,240.43	313,708,101.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90,873,240.43	313,708,101.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	846,350,583.70	671,757,652.00	1,518,108,235.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,873,240.43	90,873,240.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-117,803,254.45	-102,905,710.81	-220,708,965.26

”号填列)			
其中：1. 基金申购款	16,545,960.21	14,331,414.51	30,877,374.72
2. 基金赎回款	-134,349,214.66	-117,237,125.32	-251,586,339.98
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）	728,547,329.25	659,725,181.62	1,388,272,510.87
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,368,225,152.73	279,715,799.61	1,647,940,952.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	313,708,101.72	313,708,101.72
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）	-320,429,112.82	-82,910,403.12	-403,339,515.94
其中：1. 基金申购款	100,585,570.49	27,555,879.46	128,141,449.95
2. 基金赎回款	-421,014,683.31	-110,466,282.58	-531,480,965.89
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）	1,047,796,039.91	510,513,498.21	1,558,309,538.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

齐斌

田冲

薛有为

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安价值增长混合型证券投资基金(原名为“诺安价值增长股票证券投资基金”,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字〔2006〕209号《关于同意诺安价值增长股票证券投资基金募集的批复》核准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安价值增长股票证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,957,953,112.84元。经向中国证监会备案,《诺安价值增长股票证券投资基金基金合同》于2006年11月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,959,233,262.60份基金份额,其中认购资金利息折合1,280,149.76份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围界定为股票、债券、权证以及中国证监会批准的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的,具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债,权证等新的金融产品将在法律法规允许的范围内进行投资。现金资产主要投资于各类银行存款。本基金的投资组合比例为:股票资产的比例为60-95%,债券资产的比例为0-35%,持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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》、《诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	172,007,989.58	
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	172,007,989.58	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	820,742,804.25	1,221,057,090.03	400,314,285.78
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	820,742,804.25	1,221,057,090.03	400,314,285.78

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06月30日
应收活期存款利息	15,871.24
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	316.53
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	90.09
合计	16,277.86

注：本报告期末“其他”为应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	598,197.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	598,197.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021年06月30日
应付赎回费	1,696.36
预提费用	113,595.94
合计	115,292.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	846,350,583.70	846,350,583.70
本期申购	16,545,960.21	16,545,960.21
本期赎回（以“-”号填列）	-134,349,214.66	-134,349,214.66
本期末	728,547,329.25	728,547,329.25

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	566,336,881.02	105,420,770.98	671,757,652.00
本期利润	234,593,724.85	-143,720,484.42	90,873,240.43
本期基金份额交易产生的变动数	-91,141,682.28	-11,764,028.53	-102,905,710.81
其中：基金申购款	12,946,409.90	1,385,004.61	14,331,414.51
基金赎回款	-104,088,092.18	-13,149,033.14	-117,237,125.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	709,788,923.59	-50,063,741.97	659,725,181.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
	活期存款利息收入
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	9,504.94
其他	1,506.04
合计	245,734.64

注：本报告期内“其他”为申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,007,406,357.10
减：卖出股票成本总额	769,202,195.15
买卖股票差价收入	238,204,161.95

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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	10,926,552.79
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	10,926,552.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-143,720,484.42
——股票投资	-143,720,484.42
——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 的预估增值税	-
合计	-143,720,484.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	43,783.10
基金转换费收入	9,547.44
合计	53,330.54

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,546,144.28
银行间市场交易费用	-
合计	2,546,144.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	234.00
账户维护费	13,500.00
合计	122,829.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,428,926.43	11,092,927.52
其中：支付销售机构的客户维护费	1,842,464.09	1,936,342.43

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,738,154.42	1,848,821.30

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的2.5%的年费率计提，托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

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进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	172,007,989.58	234,723.66	195,402,135.05	403,597.67

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

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
601872	招商轮船	2020-01-10	2022-01-10	非公开发行锁定	4.47	4.33	1,119,403	5,000,000.96	4,847,014.99	-
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股锁定	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	新股锁定	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股锁定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股锁定	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688517	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新股锁定	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

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

本基金持有的流通受限股票“300948冠中生态”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积向全体股东每10股转增5股，其数量与金额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次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任

公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2021年6月30日，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合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的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动

利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	172,007,989.58	-	-	-	-	172,007,989.58
结算备付金	781,400.95	-	-	-	-	781,400.95
存出保证金	222,334.21	-	-	-	-	222,334.21
交易性金融资产	-	-	-	-	1,221,057,090.03	1,221,057,090.03
应收证券清算款	-	-	-	-	158,433.70	158,433.70
应收利息	-	-	-	-	16,277.86	16,277.86
应收申购款	-	-	-	-	92,316.05	92,316.05
资产总计	173,011,724.74	-	-	-	1,221,324,117.64	1,394,335,842.38
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	2,932,051.14	2,932,051.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,713,162.50	1,713,162.50
应付托管费	-	-	-	-	285,527.10	285,527.10
应付交易费用	-	-	-	-	598,197.47	598,197.47
应交税费	-	-	-	-	419,101.00	419,101.00
其他负债	-	-	-	-	115,292.30	115,292.30
负债总计	-	-	-	-	6,063,331.51	6,063,331.51
利率敏感度缺口	173,011,724.74	-	-	-	1,215,260,786.13	1,388,272,510.87
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	161,948,605.13	-	-	-	-	161,948,605.13
结算备付金	1,010,836.02	-	-	-	-	1,010,836.02
存出保证金	155,767.77	-	-	-	-	155,767.77
交易性金融资产	-	-	-	-	1,375,362,906.53	1,375,362,906.53
应收证券清算款	-	-	-	-	627,713.75	627,713.75
应收利息	-	-	-	-	14,001.81	14,001.81
应收申购款	300.00	-	-	-	93,779.01	94,079.01
资产总计	163,115,508.92	-	-	-	1,376,098,401.10	1,539,213,910.02
负债						

应付证券清算款	-	-	-	-	9,985,438.00	9,985,438.00
应付赎回款	-	-	-	-	7,761,954.56	7,761,954.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,840,985.87	1,840,985.87
应付托管费	-	-	-	-	306,830.97	306,830.97
应付交易费用	-	-	-	-	563,479.61	563,479.61
应交税费	-	-	-	-	419,101.00	419,101.00
其他负债	-	-	-	-	227,884.31	227,884.31
负债总计	-	-	-	-	21,105,674.32	21,105,674.32
利率敏感度缺口	163,115,508.92	-	-	-	1,354,992,726.78	1,518,108,235.70

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例为60-95%，债券投资的比例为0-35%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括

VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产 — 股票投资	1,221,057,090.03	87.96	1,375,362,906.53	90.60
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,221,057,090.03	87.96	1,375,362,906.53	90.60

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(附注6.4.1)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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	72,942,221.02	76,212,612.95
	2. 业绩比较基准下降5%	-72,942,221.02	-76,212,612.95

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,208,776,442.48元，属于第二层次的余额为12,280,647.55元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次1,358,763,813.23元，第二层次16,599,093.30元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,221,057,090.03	87.57
	其中：股票	1,221,057,090.03	87.57
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	172,789,390.53	12.39
8	其他各项资产	489,361.82	0.04
9	合计	1,394,335,842.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	9,259,065.00	0.67
C	制造业	966,875,780.49	69.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.37
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	14,528,387.58	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	18,761,779.41	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,188,923.92	7.79
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	88,361,823.75	6.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,900,376.20	0.35
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,870,600.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	1,221,057,090.03	87.96

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	601058	赛轮轮胎	12,895,905	128,830,090.95	9.28
2	600809	山西汾酒	239,009	107,076,032.00	7.71
3	000568	泸州老窖	389,995	92,015,420.30	6.63
4	002475	立讯精密	1,948,558	89,633,668.00	6.46
5	603369	今世缘	1,519,248	82,282,471.68	5.93
6	002605	姚记科技	3,679,539	80,471,517.93	5.80
7	000858	五粮液	256,569	76,429,339.41	5.51
8	600057	厦门象屿	8,848,559	55,303,493.75	3.98
9	300725	药石科技	238,920	37,966,777.20	2.73
10	603589	口子窖	547,998	37,093,984.62	2.67
11	300685	艾德生物	300,089	31,233,263.12	2.25
12	002304	洋河股份	117,500	24,346,000.00	1.75
13	002810	山东赫达	455,471	21,480,012.36	1.55
14	601677	明泰铝业	1,075,444	21,024,930.20	1.51
15	002624	完美世界	867,746	20,747,806.86	1.49
16	600779	水井坊	161,300	20,380,255.00	1.47
17	300363	博腾股份	238,200	20,037,384.00	1.44
18	603986	兆易创新	105,260	19,778,354.00	1.42

19	601888	中国中免	65,700	19,716,570.00	1.42
20	603801	志邦家居	499,608	15,967,471.68	1.15
21	603565	中谷物流	465,847	13,886,899.07	1.00
22	002353	杰瑞股份	308,800	13,803,360.00	0.99
23	002384	东山精密	630,300	13,135,452.00	0.95
24	600063	皖维高新	2,533,002	12,968,970.24	0.93
25	002677	浙江美大	695,176	12,707,817.28	0.92
26	601636	旗滨集团	666,200	12,364,672.00	0.89
27	002271	东方雨虹	214,800	11,882,736.00	0.86
28	600132	重庆啤酒	54,420	10,772,439.00	0.78
29	601607	上海医药	458,000	9,677,540.00	0.70
30	603811	诚意药业	551,760	9,573,036.00	0.69
31	600256	广汇能源	2,780,500	9,259,065.00	0.67
32	603010	万盛股份	417,540	8,755,813.80	0.63
33	603300	华铁应急	731,900	8,292,427.00	0.60
34	688521	芯原股份	86,089	6,712,359.33	0.48
35	300482	万孚生物	98,704	6,385,161.76	0.46
36	002724	海洋王	450,200	6,127,222.00	0.44
37	600143	金发科技	272,700	5,688,522.00	0.41
38	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.37
39	300280	紫天科技	138,300	5,049,333.00	0.36
40	002607	中公教育	234,580	4,900,376.20	0.35
41	300413	芒果超媒	71,000	4,870,600.00	0.35
42	601872	招商轮船	1,119,403	4,847,014.99	0.35
43	000513	丽珠集团	96,200	4,811,924.00	0.35
44	600426	华鲁恒升	154,730	4,788,893.50	0.34
45	300661	圣邦股份	18,900	4,776,597.00	0.34
46	605266	健之佳	53,430	4,755,270.00	0.34
47	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
48	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.02
49	688286	敏芯股份	1,681	234,297.78	0.02

50	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.01
51	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
52	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.01
53	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
54	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
55	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
56	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
57	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
58	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.01
59	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
60	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
61	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
62	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
63	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
64	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
65	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
66	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
67	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
68	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
69	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
70	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
71	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
72	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
73	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
74	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
75	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
76	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
77	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
78	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
79	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
80	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00

81	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
82	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
83	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
84	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
85	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
86	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
87	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
88	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
89	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
90	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
91	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
92	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
93	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
94	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
95	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
96	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
97	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
98	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
99	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
100	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
101	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
102	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
103	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
104	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
105	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
106	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
107	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
108	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
109	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
110	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
111	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00

112	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
113	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
114	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
115	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
116	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
117	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
118	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
119	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
120	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
121	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
122	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
123	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
124	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
125	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
126	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
127	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
128	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
129	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
130	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
131	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
132	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600057	厦门象屿	55,719,532.38	3.67
2	002605	姚记科技	50,200,706.36	3.31
3	601058	赛轮轮胎	49,995,440.79	3.29
4	601677	明泰铝业	24,995,882.46	1.65
5	603589	口子窖	24,988,683.00	1.65

6	603565	中谷物流	21,382,074.52	1.41
7	600219	南山铝业	20,999,252.57	1.38
8	600779	水井坊	20,966,714.00	1.38
9	002384	东山精密	19,995,158.00	1.32
10	000858	五粮液	19,937,053.00	1.31
11	002381	双箭股份	15,997,335.00	1.05
12	601717	郑煤机	14,999,647.32	0.99
13	600143	金发科技	14,996,542.00	0.99
14	002236	大华股份	14,996,245.00	0.99
15	002459	晶澳科技	14,995,735.00	0.99
16	603986	兆易创新	14,982,644.40	0.99
17	601012	隆基股份	14,972,058.58	0.99
18	601888	中国中免	14,958,674.00	0.99
19	002271	东方雨虹	12,990,447.00	0.86
20	603010	万盛股份	11,996,299.48	0.79

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	117,960,103.00	7.77
2	000661	长春高新	69,892,701.62	4.60
3	000568	泸州老窖	69,449,932.48	4.57
4	600809	山西汾酒	53,899,254.00	3.55
5	000858	五粮液	39,946,025.50	2.63
6	600456	宝钛股份	34,504,114.00	2.27
7	002080	中材科技	33,946,993.98	2.24
8	002459	晶澳科技	27,192,851.00	1.79
9	002677	浙江美大	26,599,421.24	1.75
10	603987	康德莱	24,642,075.40	1.62
11	002641	永高股份	22,046,048.12	1.45

12	600219	南山铝业	20,198,517.70	1.33
13	002867	周大生	16,310,269.50	1.07
14	600110	诺德股份	15,450,763.00	1.02
15	601058	赛轮轮胎	13,998,436.00	0.92
16	002236	大华股份	13,738,146.00	0.90
17	601012	隆基股份	13,491,150.00	0.89
18	002381	双箭股份	13,207,096.97	0.87
19	603565	中谷物流	11,523,290.00	0.76
20	601717	郑煤机	11,264,771.66	0.74

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	758,616,863.07
卖出股票收入（成交）总额	1,007,406,357.10

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	222,334.21
2	应收证券清算款	158,433.70
3	应收股利	-
4	应收利息	16,277.86
5	应收申购款	92,316.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	489,361.82

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

本基金本报告期期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
41,132	17,712.42	3,044,331.56	0.42%	725,502,997.69	99.58%

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	177.90	0.0000%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年11月21日)基金份额总额	5,959,233,262.60
本报告期期初基金份额总额	846,350,583.70
本报告期基金总申购份额	16,545,960.21
减：本报告期基金总赎回份额	134,349,214.66
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	728,547,329.25

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

李强先生担任公司董事长、于东升先生担任公司副总经理、总经理齐斌先生代任公司督察长；秦维舟先生不再担任公司董事长、马宏先生不再担任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	597,508,649.92	34.10%	556,461.22	41.24%	-
东方财富	1	543,595,466.35	31.02%	223,587.11	16.57%	-
中银国际	1	361,793,889.49	20.65%	336,941.66	24.97%	-
东方证券	1	218,704,512.11	12.48%	203,679.07	15.10%	-
国泰君安	1	20,416,515.46	1.17%	19,013.93	1.41%	-
中金公司	1	10,230,260.34	0.58%	9,527.94	0.71%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

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

(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

本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-04
2	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-04
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-05
4	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加烟台银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-06
5	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-16

		》	
6	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-22
7	诺安价值增长混合型证券投资基金2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021-01-22
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-02-08
9	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
10	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-12
11	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-29
12	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-31
13	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-31

		》、《证券日报》	
14	诺安价值增长混合型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站	2021-03-31
15	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-04-01
16	诺安基金管理有限公司旗下基金2021年第1季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-04-22
17	诺安价值增长混合型证券投资基金2021年第1季度报告	基金管理人网站	2021-04-22
18	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021-04-28
19	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2021-05-29
20	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-06-11
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金开展的基金赎回费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-06-21
22	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021-06-26
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、	2021-06-30

	金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
24	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-06-30

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安价值增长股票证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安价值增长混合型证券投资基金托管协议》。

④《诺安基金管理有限公司关于诺安价值增长股票证券投资基金变更基金名称及类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥诺安价值增长混合型证券投资基金2021年中期报告正文。

⑦报告期内诺安价值增长混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

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
二〇二一年八月三十一日