

# 诺安恒鑫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:招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。

基金托管人招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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§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	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§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	16
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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	47
§10 重大事件揭示 .....	47
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安恒鑫混合型证券投资基金
基金简称	诺安恒鑫混合
基金主代码	006429
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月30日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	80,210,488.98份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过大类资产的配置，动态控制组合风险，并在各大类资产中进行个股、个券精选，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。</p> <p>3、固定收益资产投资策略</p>

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

#### 4、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换债券定价模型进行估值分析，对具有较高安全边际和较高上涨潜力的可转换债券进行投资，获取稳健的投资回报。此外，可转换公司债券可以按照协议价格转换为上市公司股票，因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。基金管理人在日常交易过程中将密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系，选择合适的时机进行套利。

#### 5、衍生品投资策略

##### (1) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

##### (2) 国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理

	<p>原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	招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	95555
传真	0755-83026677	0755-83195201
注册地址	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址	深圳市深南大道4013号兴业 银行大厦19-20层	深圳市深南大道7088号招商 银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	秦维舟	缪建民

## 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.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	20,572,956.34	
本期利润	12,326,342.46		
加权平均基金份额本期利润	0.1303		
本期加权平均净值利润率	8.15%		
本期基金份额净值增长率	7.48%		
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	51,791,339.57	
	期末可供分配基金份额利润	0.6457	
	期末基金资产净值	132,001,828.55	
	期末基金份额净值	1.6457	

<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	64.57%

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	3.70%	0.80%	-1.13%	0.48%	4.83%	0.32%
过去三个月	4.26%	0.89%	2.64%	0.59%	1.62%	0.30%
过去六个月	7.48%	1.32%	1.26%	0.79%	6.22%	0.53%
过去一年	47.32%	1.35%	16.48%	0.80%	30.84%	0.55%
自基金合同生效起至今	64.57%	1.14%	24.91%	0.78%	39.66%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×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

诺安恒鑫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  
(2019年04月30日-2021年06月30日)



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时本基金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		
韩冬燕	本基金基金经理	2019年04月30日	-	17年	硕士，具有基金从业资格。曾任职于华夏基金管理有限公司，先后从事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司，从事行业研究工作，现任权益投资事业部总经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理，2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理

					，2019年4月起任诺安恒鑫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基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安恒鑫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《诺安恒鑫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

从影响A股证券市场的主要驱动因素来看，疫情和宽松政策对经济的影响逐步减弱，中国经济长期处于转型阶段，面临的仍然是长期的结构转型问题和动力提升问题，科技趋势上处于由产业数字化、新能源和工业互联网等积极推动下相对比较活跃的向上阶段，经济发展呈现出增长速度温和、结构上质量提升的态势，通胀处于温和区间，有助于ROE和企业盈利的提升；流动性方面，中国经济增长速度逐步趋缓部分缓解对全球通胀和美债收益率的过分担忧；估值上，存在结构性高估，但市场总体估值无明显高估，这些因素叠加起来持续使得A股证券市场呈现震荡向上走势。

在投资策略上，我们维持市场震荡向上的判断，仓位控制不是目标、是结构比较和个股选择的结果，结构比较是产业趋势研究和个股收益率比较之后的结果。上半年国家政策方向上继续强调“打通国内大循环、国内国际双循环点”，还具体提出“要引领产业优化升级，强化国家战略科技力量，积极发展工业互联网，加快产业数字化”、“要有序突进碳达峰、碳中和工作，积极发展新能源”，指明了中国经济的转型方向，其中涉及的消费制造、产业数字化浪潮中的科技运用和新能源方向也是我们 从产业结构变迁趋势、产业发展空间和行业景气度等角度选择的重点投资方向。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安恒鑫混合基金份额净值为1.6457元；本报告期内，基金份额净值增长率为7.48%，同期业绩比较基准收益率为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

长期而言，中国宏观经济正在走向高质量发展的路上、权益市场总体处于有温和流动性支撑和友好政策支持的阶段、中国权益资产性价比在全球对比中仍有较大吸引力等因素继续支持A股市场长期总体向上，节奏上的震荡风险和结构上的高估值风险需要考虑，在部分优质资产已然享受昂贵估值的市场现实下，更需要精选结构和个股。在结构和个股的选择上，我们会坚持动态的视角努力寻找长期空间、中期趋势和短期业绩更好的契合点；在结构和个股的迭代过程中，我们需要从机会成本角度做更多的风险收益比较和权衡分析；我们未来将在这两个方面努力提升，争取为持有人获得更优秀的长期投资回报。

衷心感谢持有人把投资的任务托付给我们！

## 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

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12次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

#### 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

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：诺安恒鑫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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,445,577.67	20,608,734.05
结算备付金		280,633.53	592,249.20
存出保证金		61,985.87	117,841.30
交易性金融资产	6.4.7.2	118,765,241.21	162,719,674.68
其中：股票投资		118,765,241.21	162,719,674.68
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		550,201.33	-
应收利息	6.4.7.5	1,183.76	2,156.31
应收股利		-	-
应收申购款		21,400.96	10,361.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		134,126,224.33	184,051,016.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		92.50	-
应付赎回款		1,689,789.74	964,820.75
应付管理人报酬		163,422.37	232,403.13
应付托管费		27,237.09	38,733.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	166,713.83	209,954.20
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	77,140.25	41,908.44
负债合计		2,124,395.78	1,487,820.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	80,210,488.98	119,239,018.88
未分配利润	6.4.7.10	51,791,339.57	63,324,177.62
所有者权益合计		132,001,828.55	182,563,196.50
负债和所有者权益总计		134,126,224.33	184,051,016.85

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.6457元，基金份额总额80,210,488.98份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安恒鑫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	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		14,306,493.37	21,635,977.52

1. 利息收入		29,803.09	286,439.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,803.09	274,932.07
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		-	11,507.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,461,884.32	31,293,583.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,047,687.40	27,667,424.15
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		-	-
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	1,414,196.92	3,626,159.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,246,613.88	-10,585,594.36
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	61,419.84	641,548.65
<b>减：二、费用</b>		1,980,150.91	5,482,638.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,131,070.36	3,152,053.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	188,511.72	525,342.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	580,262.86	1,709,659.31

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	80,305.97	95,584.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,326,342.46	16,153,338.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,326,342.46	16,153,338.84

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安恒鑫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)	119,239,018.88	63,324,177.62	182,563,196.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,326,342.46	12,326,342.46
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）	-39,028,529.90	-23,859,180.51	-62,887,710.41
其中：1. 基金申购款	6,572,782.03	3,999,269.88	10,572,051.91
2. 基金赎回款	-45,601,311.93	-27,858,450.39	-73,459,762.32
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）	80,210,488.98	51,791,339.57	132,001,828.55
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）	735,163,535.47	42,233,891.84	777,397,427.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,153,338.84	16,153,338.84
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）	-500,481,395.78	-30,906,597.33	-531,387,993.11
其中：1. 基金申购款	15,803,882.06	875,023.77	16,678,905.83
2. 基金赎回款	-516,285,277.84	-31,781,621.10	-548,066,898.94
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）	234,682,139.69	27,480,633.35	262,162,773.04

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

诺安恒鑫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”)《关于准予诺安恒鑫混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2018〕1422号)以及《关于诺安恒鑫混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函〔2019〕670号)批准,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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《诺安恒鑫混合型证券投资基金合同》发售,基金合同于2019年4月30日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为1,720,052,225.12份基金份额,其中认购资金利息折合468,253.39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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》和《诺安恒鑫混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指期货、国债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相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金股票资产投资占基金资产的比例为50%-95%,每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在1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。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证券监督管理委员会(以下简称“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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,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。

#### 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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	14,445,577.67
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	14,445,577.67	

##### 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	105,302,596.44	118,765,241.21	13,462,644.77

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		105,302,596.44	118,765,241.21	13,462,644.77

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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	1,029.56
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	126.30
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	27.90
合计	1,183.76

注：此处“其他”为应收保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	166,713.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	166,713.83

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	276.79
应付证券出借违约金	-
预提费用	76,863.46
合计	77,140.25

#### 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	119,239,018.88	119,239,018.88
本期申购	6,572,782.03	6,572,782.03
本期赎回（以“-”号填列）	-45,601,311.93	-45,601,311.93
本期末	80,210,488.98	80,210,488.98

注：本期申购含转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（金）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	61,008,575.98	2,315,601.64	63,324,177.62
本期利润	20,572,956.34	-8,246,613.88	12,326,342.46
本期基金份额交易产生的变动数	-24,371,997.51	512,817.00	-23,859,180.51
其中：基金申购款	4,232,918.40	-233,648.52	3,999,269.88
基金赎回款	-28,604,915.91	746,465.52	-27,858,450.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,209,534.81	-5,418,195.24	51,791,339.57

#### 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	27,232.48
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	1,954.29
其他	616.32
合计	29,803.09

注：此处“其他”为申购款利息收入及保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	227,708,148.38
减：卖出股票成本总额	206,660,460.98
买卖股票差价收入	21,047,687.40

#### 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	1,414,196.92
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	1,414,196.92

## 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	-8,246,613.88
——股票投资	-8,246,613.88
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,246,613.88

## 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	58,887.85

转换费收入	2,531.99
合计	61,419.84

#### 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	580,262.86
银行间市场交易费用	-
合计	580,262.86

#### 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	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,442.51
合计	80,305.97

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内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
招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通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 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通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 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不存在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	1,131,070.36	3,152,053.16
其中：支付销售机构的客户维护费	460,351.42	1,016,424.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%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	188,511.72	525,342.18

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无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内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内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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人运用自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
招商银行股份有限公司	14,445,577.67	27,232.48	74,288,283.35	266,472.98

注：本基金的银行存款由基金托管人招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内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	新股锁定	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	新股锁定	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	12.76	39.20	2,597	33,137.72	101,802.40	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	新股锁定	36.35	79.48	884	32,133.40	70,260.32	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股锁定	33.62	53.14	1,064	35,771.68	56,540.96	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新股锁定	14.48	19.21	2,683	38,849.84	51,540.43	-
688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	新股锁定	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,025	39,821.25	39,821.25	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新股锁定	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	165	4,747.05	16,475.25	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	135	3,817.80	15,620.85	-
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	-
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	-
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	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	249	5,306.19	12,435.06	-
605287	德才	2021-01-01	2021-07-01	新股	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

	股份	6-28	06	未上市						
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	24.69	31.71	325	8,024.25	10,305.75	-
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	335	3,926.20	9,071.80	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	648	4,451.76	7,821.36	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	8.42	13.60	575	4,841.50	7,820.00	-
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	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	224	3,312.96	6,847.68	-
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	-
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	2021-0	2021-10-	新股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	4-02	13	锁定						
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	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	151	3,759.90	3,746.31	-

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，其数量与金额也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

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无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

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金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，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人为最大限度地实现公司风险管理的目标，以各机构及职能部门为依托，自上而下，建立了包括公司治理结构层、公司经营管理层、职能机构层、具体操作层在内的四级风险管理组织架构。

在公司治理结构层面，由董事会及其下设的合规审查与风险控制委员会进行宏观领导；在公司经营管理层面，由督察长领导下的合规风控委员会进行中观管理；在合规风控职能机构层面，公司设立独立的监察稽核部和风险控制部作为合规风控管理的职能部门；在具体操作层面，公司各业务部门及分支机构，负责具体合规风控管理职责的执行和操作。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于2021年6月30日，本基金未持有债券(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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险控制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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除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，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成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。首先，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，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金无重大流动性风险。

#### 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。

本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

##### 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	14,445,577.67	-	-	-	-	14,445,577.67
结算备付金	280,633.53	-	-	-	-	280,633.53
存出保证金	61,985.87	-	-	-	-	61,985.87
交易性金融资产	-	-	-	-	118,765,241.21	118,765,241.21
应收证券清算款	-	-	-	-	550,201.33	550,201.33
应收利息	-	-	-	-	1,183.76	1,183.76
应收申购款	100.00	-	-	-	21,300.96	21,400.96
资产总计	14,788,297.07	-	-	-	119,337,927.26	134,126,224.33
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	92.50	92.50
应付赎回款	-	-	-	-	1,689,789.74	1,689,789.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	163,422.37	163,422.37
应付托管费	-	-	-	-	27,237.09	27,237.09
应付交易费用	-	-	-	-	166,713.83	166,713.83
其他负债	-	-	-	-	77,140.25	77,140.25
负债总计	-	-	-	-	2,124,395.78	2,124,395.78
利率敏感度缺口	14,788,297.07	-	-	-	117,213,531.48	132,001,828.55
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	20,608,734.05	-	-	-	-	20,608,734.05
结算备付金	592,249.20	-	-	-	-	592,249.20
存出保证金	117,841.30	-	-	-	-	117,841.30
交易性金融资产	-	-	-	-	162,719,674.68	162,719,674.68
应收利息	-	-	-	-	2,156.31	2,156.31
应收申购款	-	-	-	-	10,361.31	10,361.31
资产总计	21,318,824.55	-	-	-	162,732,192.30	184,051,016.85
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	964,820.75	964,820.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	232,403.13	232,403.13
应付托管费	-	-	-	-	38,733.83	38,733.83
应付交易费用	-	-	-	-	209,954.20	209,954.20
其他负债	-	-	-	-	41,908.44	41,908.44
负债总计	-	-	-	-	1,487,820.35	1,487,820.35
利率敏感度缺口	21,318,824.55	-	-	-	161,244,371.95	182,563,196.50

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，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（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

本基金承受的其他价格风险，主要是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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 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	118,765,241.21	89.97	162,719,674.68	89.13
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	118,765,241.21	89.97	162,719,674.68	89.13

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化		
	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
	业绩比较基准上升5%	6,290,549.97	8,676,104.91

	业绩比较基准下降5%	-6,290,549.97	-8,676,104.91
--	------------	---------------	---------------

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

#### 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) 以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为112,699,477.98元，属于第二层次的余额为6,065,763.23元，无属于第三层次的余额。(2020年12月31日：第一层次余额为159,771,426.95元，属于第二层次的余额为2,948,247.73元，无属于第三层次的余额。)

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

##### (2) 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §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	118,765,241.21	88.55
	其中：股票	118,765,241.21	88.55

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	14,726,211.20	10.98
8	其他各项资产	634,771.92	0.47
9	合计	134,126,224.33	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	0.01
B	采矿业	10,512.39	0.01
C	制造业	84,641,576.75	64.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,188,705.41	3.93
E	建筑业	4,486,381.73	3.40
F	批发和零售业	40,279.77	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	40,109.01	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,377,655.63	10.13
J	金融业	7,469,719.40	5.66
K	房地产业	10,095.90	0.01
L	租赁和商务服务业	3,170,764.36	2.40
M	科学研究和技术服务业	247,702.56	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	43,695.59	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	16,262.03	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,490.40	0.01
S	综合	-	-
	合计	118,765,241.21	89.97

## 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	600887	伊利股份	280,018	10,313,062.94	7.81
2	000338	潍柴动力	508,000	9,077,960.00	6.88
3	000333	美的集团	108,800	7,765,056.00	5.88
4	600050	中国联通	1,688,000	7,292,160.00	5.52
5	000538	云南白药	60,791	7,034,734.52	5.33
6	601012	隆基股份	70,046	6,222,886.64	4.71
7	002415	海康威视	88,000	5,676,000.00	4.30
8	002594	比亚迪	22,000	5,522,000.00	4.18
9	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	3.90
10	000157	中联重科	500,000	4,620,000.00	3.50
11	002614	奥佳华	200,000	4,526,000.00	3.43
12	601117	中国化学	508,000	4,450,080.00	3.37
13	688981	中芯国际	70,000	4,327,400.00	3.28
14	002236	大华股份	200,601	4,232,681.10	3.21
15	002230	科大讯飞	60,000	4,054,800.00	3.07
16	601169	北京银行	800,000	3,896,000.00	2.95
17	601601	中国太保	120,000	3,476,400.00	2.63
18	603385	惠达卫浴	330,980	3,253,533.40	2.46
19	002027	分众传媒	330,000	3,105,300.00	2.35
20	603899	晨光文具	36,000	3,044,160.00	2.31
21	601877	正泰电器	80,000	2,670,400.00	2.02

22	601966	玲珑轮胎	58,006	2,537,182.44	1.92
23	600406	国电南瑞	84,980	1,974,935.20	1.50
24	688012	中微公司	8,000	1,327,360.00	1.01
25	688269	凯立新材	1,625	226,720.00	0.17
26	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.12
27	688601	力芯微	775	142,677.50	0.11
28	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.10
29	688621	阳光诺和	1,337	118,725.60	0.09
30	688345	博力威	1,599	117,606.45	0.09
31	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.09
32	688625	呈和科技	1,950	104,188.50	0.08
33	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.08
34	688315	诺禾致源	2,597	101,802.40	0.08
35	688425	铁建重工	15,731	96,273.72	0.07
36	688161	威高骨科	865	91,733.25	0.07
37	688276	百克生物	884	70,260.32	0.05
38	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.05
39	688633	星球石墨	1,064	56,540.96	0.04
40	688663	新风光	2,683	51,540.43	0.04
41	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.04
42	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.04
43	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.04
44	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.03
45	688499	利元亨	1,025	39,821.25	0.03
46	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.03
47	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.03
48	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.03
49	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.03
50	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
51	300894	火星人	490	33,320.00	0.03
52	603529	爱玛科技	543	31,559.16	0.02

53	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.02
54	300887	谱尼测试	304	27,174.56	0.02
55	300910	瑞丰新材	233	24,360.15	0.02
56	300861	美畅股份	281	23,691.11	0.02
57	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.02
58	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
59	300900	广联航空	539	20,147.82	0.02
60	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
61	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.01
62	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.01
63	300942	易瑞生物	628	18,130.71	0.01
64	300953	震裕科技	165	16,475.25	0.01
65	300872	天阳科技	450	16,335.00	0.01
66	605098	行动教育	289	16,262.03	0.01
67	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.01
68	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.01
69	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
70	300973	立高食品	135	15,620.85	0.01
71	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.01
72	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
73	300941	创识科技	284	14,234.06	0.01
74	605180	华生科技	384	14,208.00	0.01
75	300907	康平科技	473	13,915.66	0.01
76	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.01
77	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
78	300877	金春股份	364	13,384.28	0.01
79	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
80	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
81	300902	国安达	551	12,981.56	0.01
82	300925	法本信息	493	12,960.97	0.01
83	300878	维康药业	275	12,834.25	0.01

84	300909	汇创达	295	12,714.50	0.01
85	300864	南大环境	228	12,542.28	0.01
86	300873	海晨股份	286	12,243.66	0.01
87	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
88	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.01
89	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.01
90	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.01
91	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.01
92	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
93	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.01
94	300892	品渥食品	233	10,690.04	0.01
95	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.01
96	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.01
97	300860	锋尚文化	180	10,490.40	0.01
98	300932	三友联众	325	10,305.75	0.01
99	605189	富春染织	423	10,190.07	0.01
100	300917	特发服务	365	10,095.90	0.01
101	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.01
102	300908	仲景食品	168	10,011.12	0.01
103	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.01
104	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.01
105	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
106	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
107	300893	松原股份	414	9,240.48	0.01
108	300952	恒辉安防	335	9,071.80	0.01
109	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
110	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.01
111	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.01
112	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
113	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
114	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01

115	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
116	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
117	300868	杰美特	264	8,081.04	0.01
118	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
119	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
120	300968	格林精密	648	7,821.36	0.01
121	300978	东箭科技	575	7,820.00	0.01
122	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.01
123	300986	志特新材	224	6,847.68	0.01
124	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
125	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
126	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
127	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
128	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
129	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
130	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
131	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
132	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
133	300985	致远新能	151	3,746.31	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	002236	大华股份	9,458,330.00	5.18
2	601117	中国化学	9,169,949.42	5.02
3	600050	中国联通	9,081,940.00	4.97
4	002230	科大讯飞	9,014,108.98	4.94
5	603609	禾丰股份	8,119,508.74	4.45
6	601877	正泰电器	6,736,763.20	3.69
7	000538	云南白药	6,566,355.01	3.60

8	002705	新宝股份	5,906,456.62	3.24
9	600597	光明乳业	5,773,553.80	3.16
10	002415	海康威视	5,548,586.00	3.04
11	601138	工业富联	5,548,040.00	3.04
12	600298	安琪酵母	5,073,609.00	2.78
13	002594	比亚迪	5,070,339.00	2.78
14	002572	索菲亚	4,815,554.00	2.64
15	688981	中芯国际	4,414,563.60	2.42
16	000333	美的集团	4,306,722.55	2.36
17	601601	中国太保	4,222,218.00	2.31
18	601169	北京银行	4,180,000.00	2.29
19	600019	宝钢股份	3,802,683.00	2.08
20	603008	喜临门	3,566,370.00	1.95

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	002230	科大讯飞	12,070,666.70	6.61
2	603609	禾丰股份	10,794,848.06	5.91
3	601138	工业富联	10,259,225.20	5.62
4	600597	光明乳业	9,781,137.00	5.36
5	601966	玲珑轮胎	9,691,553.92	5.31
6	601117	中国化学	9,477,929.00	5.19
7	002236	大华股份	9,096,524.00	4.98
8	002511	中顺洁柔	8,807,915.00	4.82
9	603385	惠达卫浴	8,219,924.73	4.50
10	002572	索菲亚	8,034,514.72	4.40
11	601318	中国平安	7,737,991.00	4.24
12	002594	比亚迪	7,727,002.00	4.23
13	601877	正泰电器	7,494,519.00	4.11

14	000538	云南白药	7,072,050.88	3.87
15	601166	兴业银行	6,161,001.29	3.37
16	002415	海康威视	6,007,601.00	3.29
17	603816	顾家家居	5,840,766.41	3.20
18	000725	京东方 A	5,746,400.00	3.15
19	600298	安琪酵母	5,036,081.72	2.76
20	000157	中联重科	4,786,120.00	2.62
21	002661	克明食品	4,587,745.00	2.51
22	601012	隆基股份	4,543,949.00	2.49
23	600580	卧龙电驱	4,291,096.36	2.35
24	000869	张裕 A	4,094,377.00	2.24
25	002705	新宝股份	4,077,468.00	2.23
26	600887	伊利股份	4,023,977.00	2.20
27	603008	喜临门	3,848,083.70	2.11
28	002139	拓邦股份	3,751,779.00	2.06
29	600019	宝钢股份	3,709,371.95	2.03

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	170,952,641.39
卖出股票收入（成交）总额	227,708,148.38

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

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 7.11.2 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	61,985.87
2	应收证券清算款	550,201.33
3	应收股利	-
4	应收利息	1,183.76
5	应收申购款	21,400.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	634,771.92

##### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	3.90	新股锁定

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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
3,124	25,675.57	7,662,678.92	9.55%	72,547,810.06	90.45%

### 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	549,115.65	0.6846%

### 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(2019年04月30日)基金份额总额	1,720,052,225.12
本报告期期初基金份额总额	119,239,018.88
本报告期基金总申购份额	6,572,782.03
减：本报告期基金总赎回份额	45,601,311.93
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	80,210,488.98

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无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	
国盛证券	1	228,129,660.02	58.43%	162,280.96	53.37%	-
长城证券	1	119,772,073.21	30.68%	111,543.18	36.68%	-
国金证券	1	42,512,963.56	10.89%	30,239.46	9.95%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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没有进行其他证券投资。

#### 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

		》	
5	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
6	诺安恒鑫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
7	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
8	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
9	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
10	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
11	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
12	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》	
13	诺安恒鑫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
14	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
15	诺安恒鑫混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《中国证券报》	2021-04-06
16	诺安恒鑫混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-04-06
17	诺安恒鑫混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第1期	基金管理人网站	2021-04-06
18	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
19	诺安恒鑫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
20	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
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行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》	2021-05-07
22	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
23	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》	2021-06-11

		、《中国证券报》、《证券日报》	
24	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
25	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
26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-06-30
27	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恒鑫混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安恒鑫混合型证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤诺安恒鑫混合型证券投资基金2021年中期报告正文。
- ⑥报告期内诺安恒鑫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](http://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