

诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年年度 报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 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。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及各相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 8 日起“诺德中小盘股票型证券投资基金”变更为“诺德中小盘混合型证券投资基金”，并相应修订基金合同部分条款。此次变更基金名称并修订基金合同的事项对基金份额持有人的利益无重大实质影响，亦不涉及基金合同当事人的重大权利义务变化，依据法律法规和基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。详见诺德基金管理有限公司 2015 年 8 月 8 日披露的《关于诺德基金管理有限公司旗下股票型基金变更基金类别并修订基金合同的公告》。

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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
8.12 投资组合报告附注	49
§9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
9.2	错误!未定义书签。
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	50
§10 开放式基金份额变动	50
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	53
§12 影响投资者决策的其他重要信息	63
§13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德中小盘混合型证券投资基金
基金简称	诺德中小盘混合
场内简称	-
基金主代码	570006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月28日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,677,709.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注行业生命周期中处于成长期的公司，主要投资于具备核心竞争力的高成长型中小市值上市公司，同时也投资于具有估值优势的非成长型中小市值公司和大市值上市公司，分享中国经济和资本市场高速发展的成果。基于对世界和中国经济增长和产业结构变迁、全球技术创新和商业模式演化、上市公司争夺和把握成长机遇能力等因素的深入分析，在有效控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金将主要通过宏观、行业、公司不同层次上的深入研究，寻找具有核心竞争力的成长型中小市值企业的股票进行投资，同时，鉴于股票市场与生俱来的波动性和周期性，本基金也会选择具有估值优势的非成长型中小市值股票和大市值股票进行投资。本基金将在充分考虑预期收益与风险的基础上，构建投资组合。
业绩比较基准	中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗丽娟	王永民

	联系电话	021-68879999	010-66594896
	电子邮箱	lijuan.luo@nuodefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68877727	010-66594942
注册地址		上海浦东新区陆家嘴环路 1233 号 1201 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海浦东新区陆家嘴环路 1233 号 1201 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		潘福祥	田国立

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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	诺德基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-5,776,552.87	40,455,866.32	35,880,713.10
本期利润	-17,226,217.37	45,982,748.85	31,919,395.15
加权平均基金份额本期利润	-0.4530	0.9216	0.2670
本期加权平均净值利润率	-36.20%	55.89%	23.86%
本期基金份额净值增长率	-26.92%	63.36%	27.54%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	7,534,785.81	22,039,112.27	23,550,314.31
期末可供分配基金份额利润	0.2112	0.5596	0.3429
期末基金资产净值	43,212,495.42	65,243,466.84	92,227,699.24
期末基金份额净值	1.211	1.657	1.343

3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	64.84%	125.55%	38.07%

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。

4、 本基金合同生效日为 2010 年 6 月 28 日。

3.2 基金净值表现

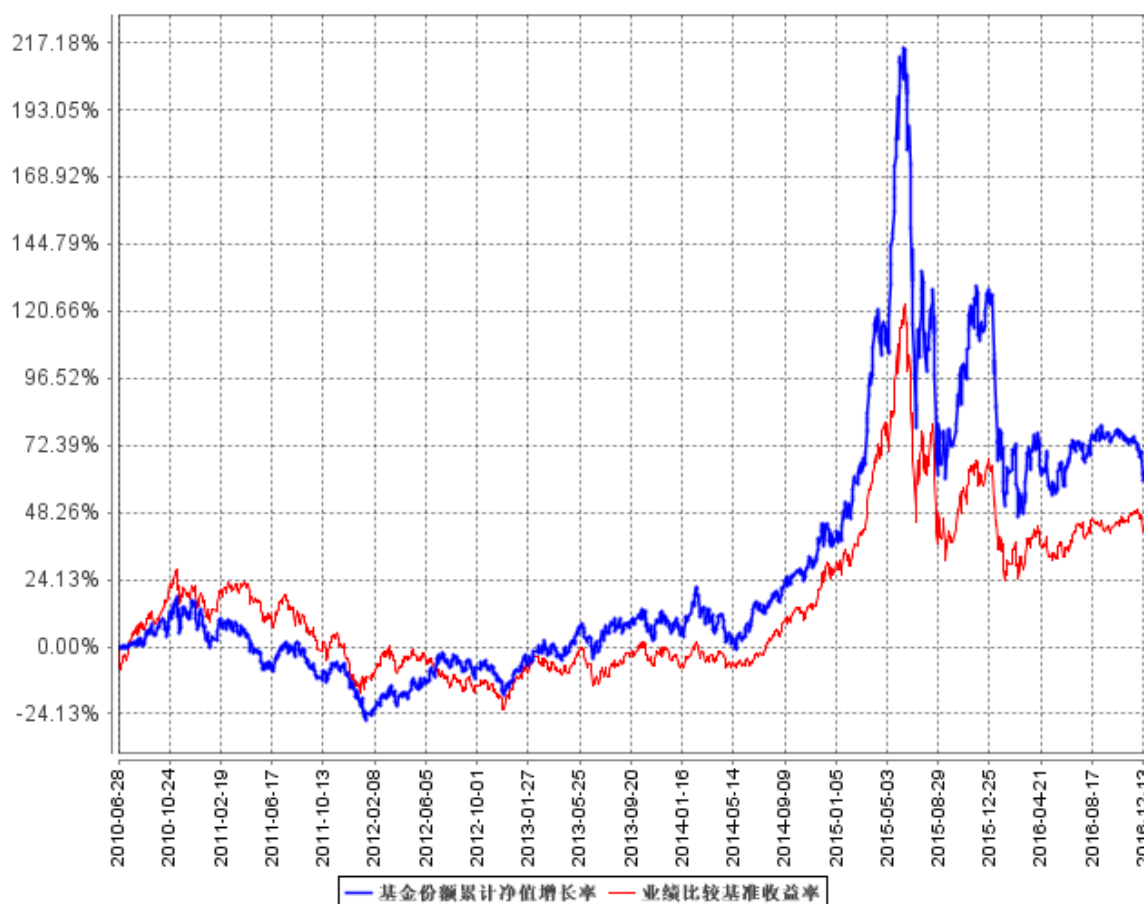
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.12%	0.76%	-0.56%	0.64%	-5.56%	0.12%
过去六个月	-4.95%	0.80%	2.55%	0.71%	-7.50%	0.09%
过去一年	-26.92%	1.91%	-13.19%	1.45%	-13.73%	0.46%
过去三年	52.27%	2.27%	45.86%	1.63%	6.41%	0.64%
过去五年	96.50%	1.92%	61.88%	1.46%	34.62%	0.46%
自基金合同生效起至今	64.84%	1.79%	41.46%	1.41%	23.38%	0.38%

注：本基金的业绩比较基准为中证 700 指数*80%+上证国债指数*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

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



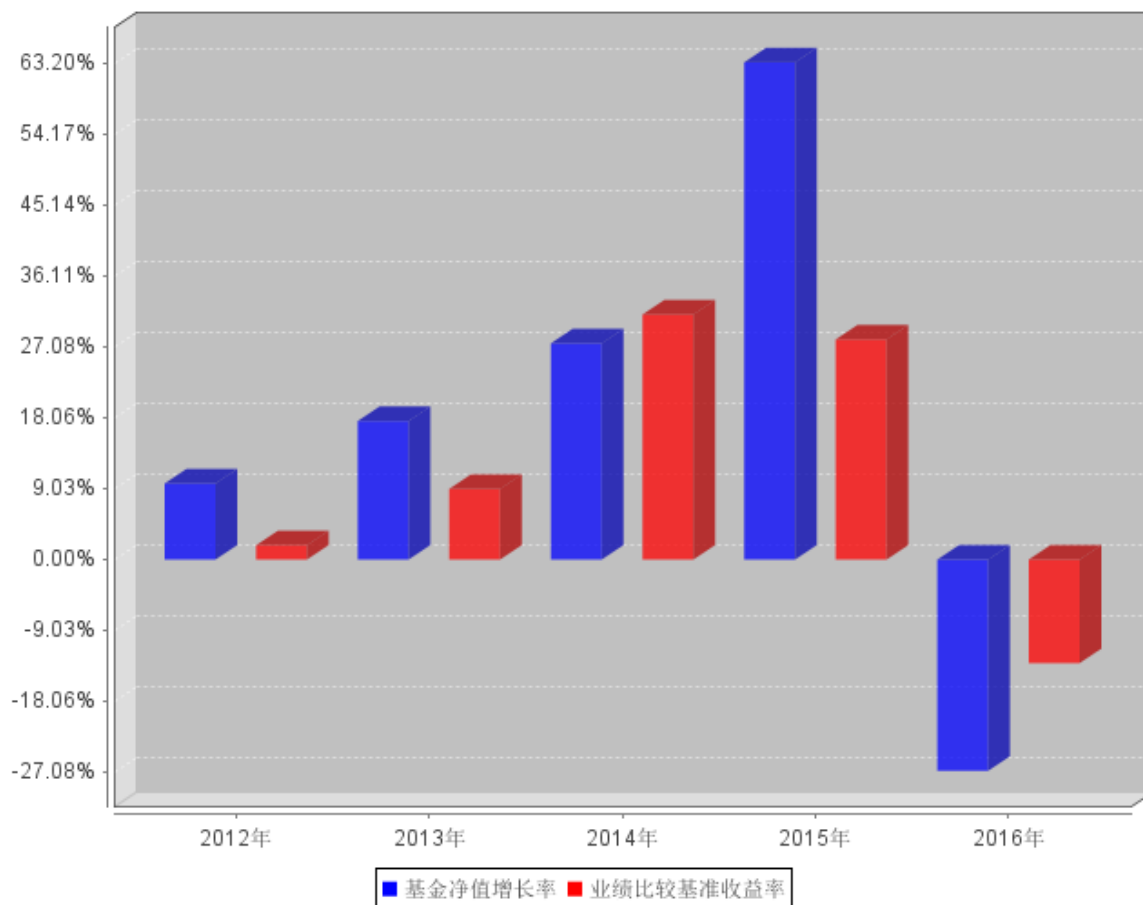
注：诺德中小盘混合型证券投资基金成立于2010年6月28日，图示时间段为2010年6月28日至2016年12月31日。

本基金建仓期间自2010年6月28日至2010年12月27日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准为中证 700 指数*80%+上证国债指数*20%

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本图为基金过 2012 年至 2016 年 12 月 31 日的基金净值增长率与业绩基准收益率比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	5.0000	23,528,639.33	5,624,410.77	29,153,050.10	
2014	-	-	-	-	
合计	5.0000	23,528,639.33	5,624,410.77	29,153,050.10	

§ 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，公司管理了十一只开放式基金：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、诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证 300 指数分级证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德天禧债券型证券投资基金。

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		
罗世锋	本基金基金经理、诺德价值优势混合型证券投资基金基金经理、诺德周期策略混合型证券投资基金基金经理、诺德优选 30 混合型证券投资基金基金经理、研究副总监	2015 年 7 月 11 日	-	8	清华大学工商管理学院硕士。2008 年 6 月加入诺德基金管理有限公司，在投资研究部从事投资管理相关工作，历任研究员、基金经理助理和基金经理职务。现任研究副总监，具有基金从业资格。
王赞	本基金基金经理	2015 年 8 月 19 日	-	9	英国阿斯顿大学商学院硕士。2007 年 9 月加入诺德基金管理有限公司，在投资研究部从事投资研究相关工作，历任研究员及基金经理助

					理职务，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---------------

注：任职日期是指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；证券从业的含义遵守行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为保证各类受托投资资金的安全，保证本公司各项资产管理业务的正常运行，维护投资者的合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定，基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》，确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合，严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，其规范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，同时包括授权、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。具体的控制措施包括：

一、实施信息隔离制度：公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；

二、公平分享研究分析报告：所有研究报告均在公司内网平台上发布，但是禁止在其他公开渠道发布，各组合经理同步获取研究分析报告资料；

三、严格控制同日反向交易：原则上禁止不同投资组合之间的同日反向交易，确实由于投资组合的投资决策或流动性等需要而发生的同日反向交易，相关投资组合经理应向投资决策委员会提供决策依据并留存记录备案；

四、公平执行交易指令：（1）交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关；（2）不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，对于需要分配交易量的交易，应当填写《公平交易审批表》，按比例分配的原则实施分配，保证不同投资组合获得公平的交易机会；（3）对于部分债券一级市

场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室应按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易，应当实施公平性审核，填写《公平交易审批表》，报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

五、实施事前审核和事后稽核：公司风险管理部门根据市场公认的第三方信息对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行事前审查，对不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行事后分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本公司在 2016 年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经 T 检验分析和贡献率分析，本投资组合与其他投资组合日内、3 日内、5 日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况，也未发现其他存在利益输送的情况。

4.3.3 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，本基金与其它组合之间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

2016 年，上证综指在年初遭遇断崖式下跌，最低下探到 2638.3 点，随后弱势震荡上行，年底收复在 3104.64 点，全年累计下跌 12.31%。沪深 300 和创业板指数分化明显，年跌幅分别 11.3% 和 27.7%。板块方面，受益消费升级的食品饮料和 PPP 政策驱动的建筑建材板块实现正收益。

本基金秉承一贯的“立足精选业绩确定性较高个股”的投资风格，行业重点落脚在人工智能、智能制造、卫教文体等新兴成长性行业，金融、地产、建筑等大市值低估值蓝筹板块基本没有配置。2016 年市场风格聚焦在在高分红蓝筹股和消费股上，而新兴板块因为受到业绩和估值的双重

压力，股价不断下挫。基金坚持优化板块和个股配置，为下阶段的成长股选择奠定基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.211 元，累计净值为 1.741 元。本报告期份额净值增长率为-26.92%，同期业绩比较基准增长率为-13.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年作为十三五的开局之年，国际市场黑天鹅事件不断，国内经济增长平稳回落。随着美国大选的落幕，加息靴子应声而落，美元强势走强。我们将经济周期、政策预期以及外汇走势这三大变量作为考察 A 股市场能否走出颓势的核心要素。随着 IPO 的恢复，资本市场秩序将逐步恢复，多层次资本市场建设将持续推进。在 A 股市场去杠杆逐步完成之际，投资者将关注经济周期、市场估值中枢以及企业核心竞争优势等要素。

2017 年全国的经济工作将坚持稳中求进的基调，确保经济平稳健康发展，促进经济提质增效，深化供给侧结构性改革。本基金坚持认为大的经济周期决定未来较长时间内的投资机会依然集中在稳定成长的消费类行业及国家政策长期重点扶持的新兴产业。一方面是为提高经济增长质量，提升人民生活水平，持续发力的教育体育，环保及市政建设领域；另一方面是以新能源汽车和智能制造为代表弯道超车行业，也将在政府的扶持下快速成长，走上健康的高速发展道路。

本基金将维持偏成长的投资风格，着重强化对新兴成长性行业以及重点个股的跟踪力度，以争取获取长期稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从保障基金份额持有人利益出发，继续加强了公司内部控制制度体系的建设，积极开展了风险管理及合规培训。公司内部设立专门的监察稽核部门，负责督促投资研究、市场营销、运营保障等业务部门合规运作，并实施定期和不定期检查，确保各项法规和公司管理制度的有效落实，发现潜在违规风险及时与相关业务部门沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具监察稽核报告。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据公司业务发展情况以及基金监管法律、法规的要求，推动公司各部门完善规章制度和业务流程建设，确保基金投资研究、销售及运营保障的制度化、规范化。

(2) 全面开展了监察稽核工作,保证了公司和基金在合法合规前提下进行投资运作。通过定期检查、不定期抽查等工作方法,加强了对投资运作的事前、事中及事后的风险控制,确保了本基金在报告期内未出现违法违规的投资行为。

(3) 报告期内,通过各部门的积极参与,重点对投资管理人员管理、投资监控措施、基金销售适用性、反洗钱工作等实际业务运作中存在的潜在风险点进行了梳理、检查,有效地防止了基金和公司投资运作和经营方面的风险。

(4) 根据监管部门的要求,完成定期的监察稽核报告及专项监察报告,及时报送中国证监会和董事会审阅。

报告期内,本基金管理人各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用;本基金运作合法合规,保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续贯彻内控优先的经营理念,进一步完善公司内部控制制度体系,加强对公司投资研究、市场营销、运营保障等环节的风险点识别及控制,提高内部监察工作的科学性和有效性,保障基金在合法合规前提下的有效运作。

4.7 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验。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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形。本基金管理人以及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在诺德中小盘混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20289 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	诺德中小盘混合型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的诺德中小盘混合型证券投资基金(以下简称“诺德中小盘基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是诺德中小盘基金 的基金管理人诺德基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述诺德中小盘基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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，公允反映了诺德中小盘基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺德中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,355,779.06	8,514,209.90
结算备付金		291,656.49	129,096.93
存出保证金		16,043.80	36,514.46
交易性金融资产	7.4.7.2	36,500,070.85	58,488,700.00
其中：股票投资		36,500,070.85	58,488,700.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,364,704.51	139,478.39
应收利息	7.4.7.5	1,327.89	1,424.34
应收股利		-	-
应收申购款		3,723.69	1,992.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		45,533,306.29	67,311,416.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		656,994.37	238,421.15
应付赎回款		40,388.10	172,879.22
应付管理人报酬		55,520.52	82,649.60
应付托管费		9,253.41	13,774.91
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	46,532.81	97,556.03
应交税费		12,075.20	12,075.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,500,046.46	1,450,593.61
负债合计		2,320,810.87	2,067,949.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	35,677,709.61	39,382,374.88
未分配利润	7.4.7.10	7,534,785.81	25,861,091.96
所有者权益合计		43,212,495.42	65,243,466.84
负债和所有者权益总计		45,533,306.29	67,311,416.56

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.211 元，基金份额总额 35,677,709.61 份。

7.2 利润表

会计主体：诺德中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-15,740,766.82	48,783,682.43
1. 利息收入		136,948.76	127,341.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	63,368.44	113,552.05
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		73,580.32	13,789.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,439,148.03	42,984,217.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,624,200.67	42,680,299.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	185,052.64	303,918.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-11,449,664.50	5,526,882.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,096.95	145,241.01
减：二、费用		1,485,450.55	2,800,933.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	715,280.50	1,229,804.36

2. 托管费	7.4.10.2.2	119,213.45	204,967.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	418,835.00	981,764.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	232,121.60	384,397.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,226,217.37	45,982,748.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,226,217.37	45,982,748.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	39,382,374.88	25,861,091.96	65,243,466.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,226,217.37	-17,226,217.37
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）	-3,704,665.27	-1,100,088.78	-4,804,754.05
其中：1. 基金申购款	7,401,853.99	1,803,897.65	9,205,751.64
2. 基金赎回款	-11,106,519.26	-2,903,986.43	-14,010,505.69
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）	35,677,709.61	7,534,785.81	43,212,495.42
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		

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》，诺德中小盘股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为诺德中小盘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《诺德中小盘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，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、债券回购、银行存款等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占基金资产的 5%-40%，其中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%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于中小盘股票。本基金投资权证的比例不超过资产的 3%。自 2011 年 7 月 1 日起，本基金业绩比较基准由原来的“天相中盘指数×40%+天相小盘指数×40%+上证国债指数×20%”变更为“中证 700 指数×80%+上证国债指数×20%”。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《诺德中小盘混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于 2016 年度出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具

有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,355,779.06	8,514,209.90
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,355,779.06	8,514,209.90

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,025,999.22	36,500,070.85	-2,525,928.37
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	39,025,999.22	36,500,070.85	-2,525,928.37
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,564,963.87	58,488,700.00	8,923,736.13
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	49,564,963.87	58,488,700.00	8,923,736.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未从事买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,175.47	1,342.27
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	144.50	63.91
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	7.92	18.15
合计	1,327.89	1,424.34

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	46,532.81	97,556.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	46,532.81	97,556.03

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	46.46	593.61
预提费用	500,000.00	450,000.00
合计	1,500,046.46	1,450,593.61

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,382,374.88	39,382,374.88
本期申购	7,401,853.99	7,401,853.99
本期赎回（以“-”号填列）	-11,106,519.26	-11,106,519.26
- 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	35,677,709.61	35,677,709.61

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,039,112.27	3,821,979.69	25,861,091.96
本期利润	-5,776,552.87	-11,449,664.50	-17,226,217.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,511,222.98	411,134.20	-1,100,088.78
其中：基金申购款	3,272,367.11	-1,468,469.46	1,803,897.65
基金赎回款	-4,783,590.09	1,879,603.66	-2,903,986.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,751,336.42	-7,216,550.61	7,534,785.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
活期存款利息收入	59,405.39	107,606.21
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	3,500.15	4,947.24
其他	462.90	998.60
合计	63,368.44	113,552.05

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	139,758,029.04	348,302,842.48
减：卖出股票成本总额	144,382,229.71	305,622,543.41
买卖股票差价收入	-4,624,200.67	42,680,299.07

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	185,052.64	303,918.45
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	185,052.64	303,918.45

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,449,664.50	5,526,882.53
——股票投资	-11,449,664.50	5,526,882.53
——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	-	-
合计	-11,449,664.50	5,526,882.53

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	10,971.25	138,339.39
转换费收入	125.70	6,901.62
合计	11,096.95	145,241.01

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 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，其中转出基金的赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	418,835.00	981,764.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	418,835.00	981,764.09

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	290,000.00
银行间债券帐户维护费	18,200.00	27,600.00
银行费用	3,921.60	6,797.84
合计	232,121.60	384,397.84

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号), 要求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, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
长江证券股份有限公司(“长江证券”)	基金管理人的原股东(2015 年 7 月 16 日之前)、基金销售机构
Lord Abbett & Co. LLC	基金管理人的原股东(2015 年 7 月 16 日之前)

注:

- 于 2015 年 7 月 16 日, 经诺德基金股东会审议通过, 并经中国证监会证监许可[2015]497 号文批准, Lord Abbett & Co.LLC 将其持有的诺德基金 49%股权转让给宜信惠民, 长江证券将其持有的诺德基金 30%股权转让给原股东清华控股。本次股权转让后, 诺德基金的股东及股权比例为: 清华控股持有 51%, 宜信惠民持有 49%。
- 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	715,280.50	1,229,804.36
其中：支付销售机构的客户维护费	258,768.95	434,122.77

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 1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	119,213.45	204,967.29

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,355,779.06	59,405.39	8,514,209.90	107,606.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	120,000	2,033,186.36	1,864,800.00	-
002664	信质电机	2016年12月16日	重大资产重组	25.39	-	-	50,000	1,652,352.00	1,269,500.00	-
300100	双林股份	2016年11月7日	重大资产重组	34.00	2017年1月25日	30.60	22,000	760,526.00	748,000.00	-

注：本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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在有效控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的回报。

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、监察稽核部组成。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

7.4.13.2 信用风险

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

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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。

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 2016 年 12 月 31 日, 本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日: 同)

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	4,355,779.06	-	-	-	-	-	4,355,779.06

结算备付金	291,656.49	-	-	-	-	-	291,656.49
存出保证金	16,043.80	-	-	-	-	-	16,043.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-36,500,070.85	36,500,070.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,364,704.51	4,364,704.51
应收利息	-	-	-	-	-	1,327.89	1,327.89
应收申购款	-	-	-	-	-	3,723.69	3,723.69
资产总计	4,663,479.35	-	-	-	-	-40,869,826.94	45,533,306.29
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	656,994.37	656,994.37
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,388.10	40,388.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,520.52	55,520.52
应付托管费	-	-	-	-	-	9,253.41	9,253.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	46,532.81	46,532.81
应交税费	-	-	-	-	-	12,075.20	12,075.20
其他负债	-	-	-	-	-	1,500,046.46	1,500,046.46
负债总计	-	-	-	-	-	-2,320,810.87	2,320,810.87
利率敏感度缺口	4,663,479.35	-	-	-	-	-38,549,016.07	43,212,495.42
上年度末 2015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	8,514,209.90	-	-	-	-	-	8,514,209.90
结算备付金	129,096.93	-	-	-	-	-	129,096.93
存出保证金	36,514.46	-	-	-	-	-	36,514.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-58,488,700.00	58,488,700.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	139,478.39	139,478.39
应收利息	-	-	-	-	-	1,424.34	1,424.34
应收申购款	-	-	-	-	-	1,992.54	1,992.54
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,679,821.29	-	-	-	-	-58,631,595.27	67,311,416.56
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	238,421.15	238,421.15
应付赎回款	-	-	-	-	-	172,879.22	172,879.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,649.60	82,649.60
应付托管费	-	-	-	-	-	13,774.91	13,774.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	97,556.03	97,556.03
应交税费	-	-	-	-	-	12,075.20	12,075.20
其他负债	-	-	-	-	-	1,450,593.61	1,450,593.61
负债总计	-	-	-	-	-	-2,067,949.72	2,067,949.72
利率敏感度缺口	8,679,821.29	-	-	-	-	-56,563,645.55	65,243,466.84

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 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(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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，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、权证等权益类资产投资比例占基金资产的 60-95%；债券、债券回购、银行存款以及其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中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%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金投资权证的比例不超过资产的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日		2015 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	36,500,070.85	84.47	58,488,700.00	89.65
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	36,500,070.85	84.47	58,488,700.00	89.65

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	217.00	319.00
	业绩比较基准下降 5%	217.00	319.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 32,617,770.85 元, 属于第二层次的余额为 3,882,300.00 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 47,440,850.00 元, 第二层次 11,047,850.00 元, 无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2016 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	36,500,070.85	80.16
	其中：股票	36,500,070.85	80.16
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,647,435.55	10.21
7	其他各项资产	4,385,799.89	9.63
8	合计	45,533,306.29	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,696,140.00	6.24
B	采矿业	2,332,100.00	5.40
C	制造业	18,393,781.85	42.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,696,600.00	3.93
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,145,649.00	9.59
J	金融业	1,444,100.00	3.34
K	房地产业	4,106,300.00	9.50
L	租赁和商务服务业	429,000.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,256,400.00	2.91
S	综合	-	-
	合计	36,500,070.85	84.47

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300145	中金环境	115,000	3,001,500.00	6.95
2	002200	云投生态	97,000	2,271,740.00	5.26
3	002491	通鼎互联	120,000	1,864,800.00	4.32
4	300182	捷成股份	170,000	1,752,700.00	4.06
5	600502	安徽水利	170,000	1,696,600.00	3.93
6	002036	联创电子	80,000	1,532,800.00	3.55
7	300203	聚光科技	50,000	1,527,500.00	3.53
8	002094	青岛金王	49,942	1,498,260.00	3.47
9	300302	同有科技	62,800	1,397,928.00	3.24
10	600266	北京城建	100,000	1,333,000.00	3.08
11	002664	信质电机	50,000	1,269,500.00	2.94
12	300144	宋城演艺	60,000	1,256,400.00	2.91
13	601898	中煤能源	200,000	1,162,000.00	2.69
14	600639	浦东金桥	60,000	1,113,600.00	2.58
15	600048	保利地产	120,000	1,095,600.00	2.54
16	601555	东吴证券	80,000	1,061,600.00	2.46
17	000423	东阿阿胶	18,000	969,660.00	2.24
18	601699	潞安环能	100,000	805,000.00	1.86
19	300100	双林股份	22,000	748,000.00	1.73
20	002196	方正电机	30,000	718,800.00	1.66
21	002350	北京科锐	30,000	624,900.00	1.45
22	603766	隆鑫通用	30,000	623,400.00	1.44
23	300011	鼎汉技术	30,000	621,600.00	1.44
24	600262	北方股份	19,400	585,298.00	1.35

25	300440	运达科技	19,900	572,921.00	1.33
26	300207	欣旺达	40,000	556,000.00	1.29
27	002150	通润装备	30,000	496,500.00	1.15
28	000976	春晖股份	50,000	488,000.00	1.13
29	601965	中国汽研	42,819	456,022.35	1.06
30	002712	思美传媒	15,000	429,000.00	0.99
31	002299	圣农发展	20,000	424,400.00	0.98
32	002544	杰赛科技	15,000	422,100.00	0.98
33	000965	天保基建	60,000	400,200.00	0.93
34	601377	兴业证券	50,000	382,500.00	0.89
35	600547	山东黄金	10,000	365,100.00	0.84
36	002007	华兰生物	9,962	356,141.50	0.82
37	000568	泸州老窖	10,000	330,000.00	0.76
38	001979	招商蛇口	10,000	163,900.00	0.38
39	600809	山西汾酒	5,000	125,100.00	0.29

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601198	东兴证券	4,964,189.00	7.61
2	300377	赢时胜	4,074,623.20	6.25
3	300145	中金环境	3,453,263.11	5.29
4	601222	林洋能源	3,248,795.00	4.98
5	300203	聚光科技	3,015,753.81	4.62
6	002200	云投生态	2,980,666.78	4.57
7	300144	宋城演艺	2,495,043.00	3.82
8	002153	石基信息	2,402,229.35	3.68
9	000783	长江证券	2,360,600.00	3.62
10	000666	经纬纺机	2,345,273.50	3.59
11	002041	登海种业	2,299,770.00	3.52
12	300267	尔康制药	2,278,000.00	3.49
13	002491	通鼎互联	2,201,850.00	3.37
14	600266	北京城建	2,176,853.00	3.34
15	600820	隧道股份	2,145,893.84	3.29

16	002036	联创电子	2,115,829.00	3.24
17	300302	同有科技	2,112,139.80	3.24
18	002196	方正电机	2,071,051.00	3.17
19	300496	中科创达	2,023,883.00	3.10
20	300182	捷成股份	2,019,800.00	3.10
21	601898	中煤能源	1,990,588.00	3.05
22	002191	劲嘉股份	1,873,500.00	2.87
23	601699	潞安环能	1,749,300.00	2.68
24	300495	美尚生态	1,739,900.00	2.67
25	603111	康尼机电	1,726,760.00	2.65
26	002664	信质电机	1,652,352.00	2.53
27	600502	安徽水利	1,632,012.00	2.50
28	300440	运达科技	1,599,143.00	2.45
29	000421	南京公用	1,585,457.00	2.43
30	600547	山东黄金	1,536,980.00	2.36
31	002329	皇氏集团	1,530,406.00	2.35
32	002292	奥飞娱乐	1,522,250.00	2.33
33	000728	国元证券	1,521,047.63	2.33
34	002094	青岛金王	1,516,904.12	2.32
35	300098	高新兴	1,514,700.00	2.32
36	000807	云铝股份	1,503,555.00	2.30
37	300315	掌趣科技	1,466,122.00	2.25
38	600585	海螺水泥	1,464,425.00	2.24
39	000401	冀东水泥	1,398,963.00	2.14
40	300351	永贵电器	1,395,462.00	2.14
41	002234	民和股份	1,387,531.88	2.13
42	002179	中航光电	1,320,300.00	2.02

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601198	东兴证券	5,096,069.00	7.81
2	300377	赢时胜	4,554,371.43	6.98
3	300145	中金环境	4,522,760.70	6.93

4	300351	永贵电器	4,173,625.00	6.40
5	601222	林洋能源	4,050,115.40	6.21
6	000666	经纬纺机	3,753,327.00	5.75
7	300144	宋城演艺	3,610,030.00	5.53
8	002292	奥飞娱乐	3,450,864.00	5.29
9	603111	康尼机电	3,435,738.00	5.27
10	300203	聚光科技	3,381,847.47	5.18
11	601021	春秋航空	2,779,675.00	4.26
12	603766	隆鑫通用	2,551,068.00	3.91
13	000783	长江证券	2,469,800.00	3.79
14	002308	威创股份	2,427,953.00	3.72
15	002041	登海种业	2,427,200.00	3.72
16	600655	豫园商城	2,348,077.00	3.60
17	002329	皇氏集团	2,275,950.00	3.49
18	600820	隧道股份	2,248,600.00	3.45
19	300059	东方财富	2,216,280.00	3.40
20	002655	共达电声	2,180,479.10	3.34
21	300496	中科创达	2,167,793.00	3.32
22	002153	石基信息	2,063,280.00	3.16
23	300267	尔康制药	2,049,700.00	3.14
24	600643	爱建集团	2,002,016.00	3.07
25	300495	美尚生态	1,914,280.00	2.93
26	002191	劲嘉股份	1,908,050.00	2.92
27	000558	莱茵体育	1,872,680.28	2.87
28	600565	迪马股份	1,872,670.00	2.87
29	000997	新大陆	1,757,350.00	2.69
30	000728	国元证券	1,676,588.00	2.57
31	000802	北京文化	1,645,636.00	2.52
32	000421	南京公用	1,603,976.00	2.46
33	300098	高新兴	1,487,121.53	2.28
34	600585	海螺水泥	1,455,628.00	2.23
35	600172	黄河旋风	1,394,023.03	2.14
36	000333	美的集团	1,367,500.00	2.10
37	601311	骆驼股份	1,352,743.00	2.07
38	300315	掌趣科技	1,351,000.00	2.07
39	600271	航天信息	1,336,107.11	2.05
40	002179	中航光电	1,330,139.00	2.04
41	002472	双环传动	1,308,598.05	2.01

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	133,843,265.06
卖出股票收入（成交）总额	139,758,029.04

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未参与股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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	16,043.80
2	应收证券清算款	4,364,704.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,327.89
5	应收申购款	3,723.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,385,799.89

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 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	002491	通鼎互联	1,864,800.00	4.32	重大事项

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,606	13,690.60	985,963.01	2.76%	34,691,746.60	97.24%

9.2 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	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月28日）基金份额总额	363,570,378.53
本报告期期初基金份额总额	39,382,374.88
本报告期基金总申购份额	7,401,853.99
减：本报告期基金总赎回份额	11,106,519.26
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	35,677,709.61

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人 2016 年 4 月 13 日发布公告，张欣（Alan Chang）先生因个人原因于 2016 年 4 月 11 日离任公司督察长，由胡志伟先生代任公司督察长。本基金管理人于 2016 年 6 月 24 日发布公告，陈玮光先生自 2016 年 6 月 23 日起任公司督察长，胡志伟先生代任督察长结束。本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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 2016 年度的基金审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的报酬人民币 6 万元，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 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	1	38,432,070.66	14.05%	35,792.05	14.05%	-
浙商证券	1	37,607,835.86	13.75%	35,024.20	13.75%	-
东北证券	1	35,486,301.05	12.97%	33,048.69	12.97%	-
光大证券	1	31,485,933.29	11.51%	29,322.84	11.51%	-
申银万国	1	30,945,943.01	11.31%	28,819.73	11.31%	-
东方证券	2	27,291,799.32	9.98%	25,416.66	9.98%	-
国泰君安	2	22,903,867.33	8.37%	21,330.61	8.37%	-
中投证券	2	20,679,627.39	7.56%	19,259.04	7.56%	-
国海证券	2	16,658,555.48	6.09%	15,514.12	6.09%	-
海通证券	1	12,109,360.71	4.43%	11,277.32	4.43%	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

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：海通证券股份有限公司。退租交易单元：安信证券股份有限公司，湘财证券股份有限公司，海通证券股份有限公司。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
民生证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	16,000,000.00	6.24%	-	-
申银万国	-	-	80,100,000.00	31.25%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	97,800,000.00	38.16%	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	62,400,000.00	24.35%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德基金管理有限公司旗下基金资产净值与份额净值公告（2015年12月31日）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月4日
2	诺德基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月4日
3	诺德基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月7日
4	诺德中小盘混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月21日
5	诺德基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年1月26日
6	诺德中小盘混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016年2月）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年2月2日
7	诺德中小盘混合型证券投资基金	中国证券报、上海证	2016年2月2日

	招募说明书（更新）（2016 年 2 月）	券报、证券时报、公司网站	
8	诺德基金管理有限公司关于旗下基金调整定期定额投资下限业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 16 日
9	诺德基金管理有限公司关于新增深圳富济财富管理有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 19 日
10	诺德基金管理有限公司关于新增上海凯石财富基金销售有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 8 日
11	诺德基金管理有限公司关于新增中期资产管理有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 8 日
12	诺德基金管理有限公司关于新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 11 日
13	诺德基金管理有限公司关于新增浙江金观诚财富管理有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 11 日

14	诺德基金管理有限公司关于新增中经北证（北京）资产管理有限 公司为旗下基金代销机构并相应 开通定投业务和转换业务及参与 费率优惠的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 3 月 12 日
15	诺德基金管理有限公司关于旗下 基金参加平安证券有限责任公司 基金定投及申购费率优惠活动的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 3 月 16 日
16	诺德中小盘混合型证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 3 月 30 日
17	诺德中小盘混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 3 月 30 日
18	诺德基金管理有限公司关于新增 中信期货有限公司为旗下基金代 销机构并相应开通定投业务和转 换业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 4 月 2 日
19	诺德基金管理有限公司关于新增 华鑫证券有限责任公司为旗下基 金代销机构并相应开通定投业务 和转换业务及参与费率优惠的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 4 月 14 日
20	诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2016 年 4 月 20 日
21	诺德基金管理有限公司关于新增 珠海盈米财富管理有限公司为旗	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公	2016 年 4 月 29 日

	下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	司网站	
22	诺德基金管理有限公司关于新增大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年5月23日
23	诺德基金管理有限公司关于新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年5月25日
24	诺德基金管理有限公司关于新增北京懒猫金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年6月8日
25	关于诺德基金管理有限公司旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年6月22日
26	诺德基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年6月24日
27	诺德基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年6月28日
28	诺德基金管理有限公司关于新增北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务以及参与费	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年6月30日

	率优惠的公告		
29	诺德基金管理有限公司旗下资产净值与份额净值公告 20160630	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
30	诺德基金管理有限公司关于新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 9 日
31	诺德基金管理有限公司关于参加厦门市鑫鼎盛控股有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 12 日
32	诺德基金管理有限公司关于参加和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 15 日
33	诺德基金管理有限公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 20 日
34	诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 21 日
35	诺德基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 8 月 2 日
36	诺德基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2016 年 8 月 4 日

	基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的更正公告	司网站	
37	诺德基金管理有限公司关于新增泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月5日
38	诺德基金管理有限公司关于新增上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月9日
39	诺德中小盘混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月9日
40	诺德中小盘混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月9日
41	诺德基金管理有限公司关于新增北京晟视天下投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月13日
42	诺德基金管理有限公司关于新增大同证券有限责任公司旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年8月16日
43	诺德基金管理有限公司关于新增尚智逢源（北京）基金销售有限	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2016年8月16日

	公司为旗下部分基金代销机构的公告	司网站	
44	诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 8 月 29 日
45	诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 8 月 29 日
46	诺德基金管理有限公司关于新增一路财富（北京）信息科技有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
47	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购和定期定额投资的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
48	诺德基金管理有限公司关于参加北京懒猫金融信息服务有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 23 日
49	诺德基金管理有限公司关于新增中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 29 日
50	诺德基金管理有限公司关于新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 9 月 29 日

51	诺德基金管理有限公司关于新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月14日
52	诺德基金管理有限公司关于旗下基金参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月14日
53	诺德基金管理有限公司关于新增晋商银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月18日
54	诺德基金管理有限公司关于新增北京格上富信投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月22日
55	诺德中小盘混合型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月25日
56	诺德基金管理有限公司关于新增上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年10月26日
57	诺德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购、赎回、定期定额投资、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016年11月2日

58	诺德基金管理有限公司关于新增大有期货有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 26 日
59	诺德基金管理有限公司关于新增上海攀赢金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 26 日
60	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购和定期定额投资的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 30 日
61	诺德基金管理有限公司关于新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 1 日
62	诺德基金管理有限公司关于新增国都证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 2 日
63	诺德基金管理有限公司关于新增上海华信证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 15 日
64	诺德基金管理有限公司关于新增杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 17 日

	费率优惠的公告		
65	诺德基金管理有限公司关于新增华融证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 21 日
66	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购和定期定额投资的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 21 日
67	诺德基金管理有限公司关于新增财达证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 24 日
68	诺德基金管理有限公司关于新增南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通转换业务和参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 28 日
69	诺德基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 29 日
70	诺德基金管理有限公司关于旗下基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准诺德中小盘股票型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、诺德中小盘混合型证券投资基金基金合同。
- 3、诺德中小盘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批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、年度报告、招募说明书及其他临时公告。
- 6、诺德中小盘混合型证券投资基金 2016 年年度报告原文。

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：www.nuodefund.com。

13.3 查阅方式

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
2017 年 3 月 30 日