

诺德中小盘混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示

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。本半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 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 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 | 32,475,874.05 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 | 021-68985058 | 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 | | 021-68985121 | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.nuodefund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 3,333,405.98 |
| 本期利润 | 5,134,901.01 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1536 |
| 本期基金份额净值增长率 | 14.48% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1779 |
| 期末基金资产净值 | 38,252,865.40 |
| 期末基金份额净值 | 1.178 |

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

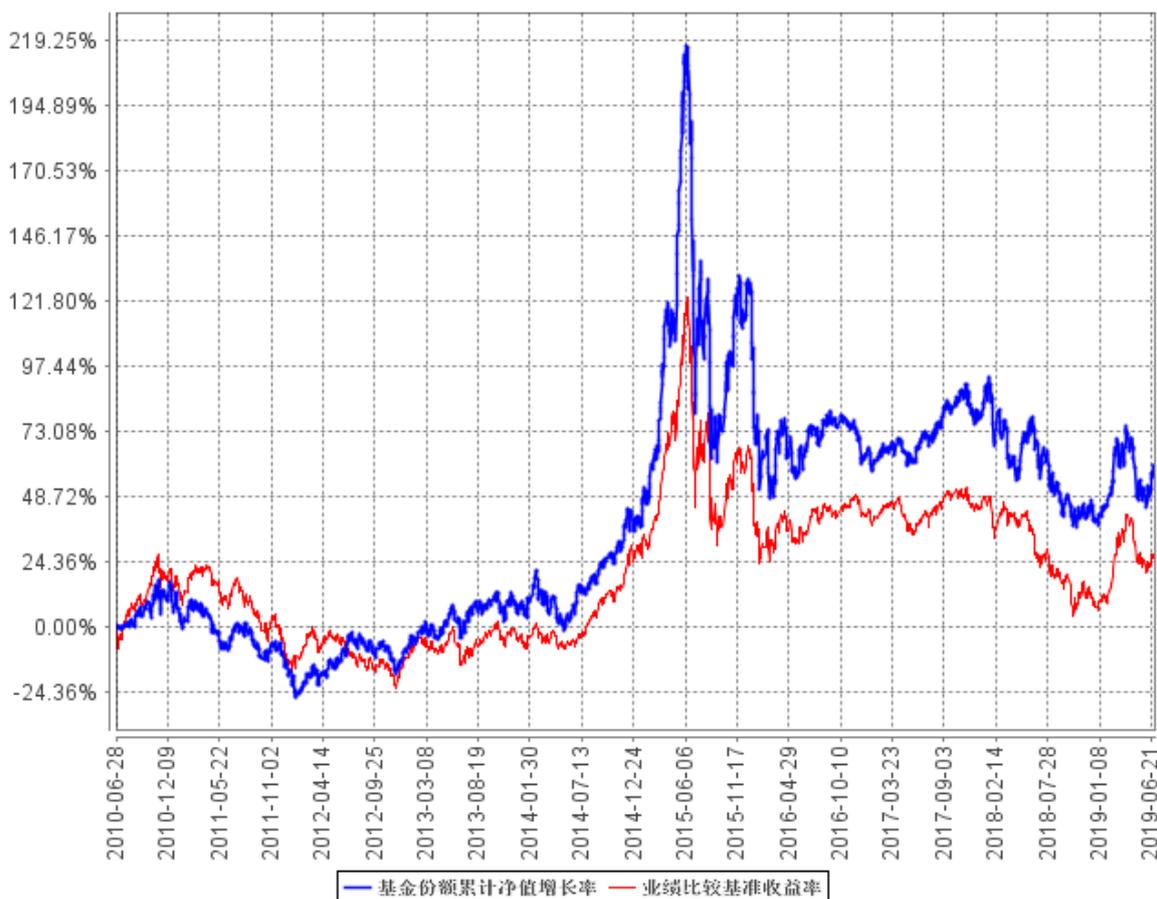
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 7.38% | 1.48% | 1.51% | 1.03% | 5.87% | 0.45% |
| 过去三个月 | -3.92% | 1.83% | -7.20% | 1.39% | 3.28% | 0.44% |
| 过去六个月 | 14.48% | 1.72% | 17.24% | 1.39% | -2.76% | 0.33% |
| 过去一年 | -2.40% | 1.47% | -1.08% | 1.33% | -1.32% | 0.14% |
| 过去三年 | -7.54% | 1.21% | -8.49% | 1.00% | 0.95% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 60.35% | 1.59% | 26.24% | 1.32% | 34.11% | 0.27% |

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：本基金成立于2010年6月28日，图示时间段为2010年6月28日至2019年6月30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。

§ 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，公司管理了二十一开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证 300 指数分级证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金以及诺德策略精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--------------------------------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 顾钰 | 本基金基金经理以及诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2017 年 12 月 27 日 | - | 8 | 上海大学金融学硕士。2011 年 5 月至 2015 年 11 月任职于恒泰证券股份有限公司，担任研究员职务。2015 年 11 月加入诺德基金管理有限公司，担任研究员职务，具有基金从业资格。 |
| 王赟 | 本基金基金经理 | 2015 年 8 月 19 日 | - | 12 | 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，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，上证综指震荡上行，最终收于 2978.88 点，上涨 19.45%。其他指数都有不同程度的上涨，沪深 300 指数、中小板指数和创业板指数分别上涨 27.07%、20.75%和 20.87%。板块方面，所有行业都实现正收益，其中食品饮料、非银金融和农林牧渔位列涨幅前三位。

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，行业重点落脚在食品饮料、汽车、零售等消费板块，以及通信、计算机、电子等科技板块。基金坚持优化板块和个股配置，为下阶段的股票选择奠定基础。本基金将维持偏成长的投资风格，着重强化对符合消费升级和科技进步等大趋势的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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.178 元，累计净值为 1.708 元。本报告期份额净值增长率为 14.48%，同期业绩比较基准增长率为 17.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着一系列改革政策的推出和落地，我们把 2019 年视为中国经济企稳向上的元年。短期来看，随着国内各项稳增长政策的出台，国外干扰因素的暂缓，经济指标正逐步企稳。长期来看，粗放的高速增长阶段已经结束，以科技为经济改革赋能，我国经济将逐步进入高质量的发展阶段，未来较长时间内的投资机会将会集中在符合消费升级和科技进步等大趋势的成长性行业。具体来说，一方面是为提升人民生活水平，持续受益于消费升级的食品饮料、家电、医药等领域；另一方面是以 5G 产业链、人工智能、云计算、进口替代、智能制造为代表的弯道超车行业，这些行业也将在政府的支持下快速成长，走上健康发展之路。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资研究部总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中：

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

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，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”）在对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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 3,187,752.59 | 4,154,452.59 |
| 结算备付金 | | 112,734.98 | 279,225.59 |
| 存出保证金 | | 23,225.80 | 17,875.70 |
| 交易性金融资产 | | 34,906,820.00 | 25,048,610.00 |
| 其中：股票投资 | | 34,906,820.00 | 25,048,610.00 |
| 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 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 1,000,000.00 | 7,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 56,379.24 | - |
| 应收利息 | | 799.03 | 5,695.94 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 52,430.88 | 54,426.12 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 39,340,142.52 | 36,560,285.94 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 759,884.55 | 1,244,611.95 |
| 应付赎回款 | | 164,631.22 | 4,606.86 |
| 应付管理人报酬 | | 44,921.09 | 45,176.83 |
| 应付托管费 | | 7,486.85 | 7,529.46 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 56,741.56 | 44,984.07 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|--|---------------|---------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 53,611.85 | 90,017.37 |
| 负债合计 | | 1,087,277.12 | 1,436,926.54 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 32,475,874.05 | 34,131,690.23 |
| 未分配利润 | | 5,776,991.35 | 991,669.17 |
| 所有者权益合计 | | 38,252,865.40 | 35,123,359.40 |
| 负债和所有者权益总计 | | 39,340,142.52 | 36,560,285.94 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.178 元，基金份额总额 32,475,874.05 份。

6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----------|--|---|
| 一、收入 | | 5,733,789.41 | -2,879,270.96 |
| 1.利息收入 | | 36,147.46 | 29,431.91 |
| 其中：存款利息收入 | | 15,221.88 | 17,356.71 |
| 债券利息收入 | | - | 12,075.20 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 20,925.58 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,892,552.49 | -1,653,493.20 |
| 其中：股票投资收益 | | 3,623,559.49 | -1,946,671.91 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 268,993.00 | 293,178.71 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 1,801,495.03 | -1,277,420.76 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 3,594.43 | 22,211.09 |
| 减：二、费用 | | 598,888.40 | 687,036.71 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 284,209.40 | 318,771.84 |
| 2. 托管费 | 6.4.8.2.2 | 47,368.26 | 53,128.67 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|--|--------------|---------------|
| 4. 交易费用 | | 203,169.05 | 260,264.34 |
| 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 | | 64,141.69 | 54,871.86 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,134,901.01 | -3,566,307.67 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 5,134,901.01 | -3,566,307.67 |

6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|--------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 34,131,690.23 | 991,669.17 | 35,123,359.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 5,134,901.01 | 5,134,901.01 |
| 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） | -1,655,816.18 | -349,578.83 | -2,005,395.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,908,774.41 | 331,350.42 | 2,240,124.83 |
| 2.基金赎回款 | -3,564,590.59 | -680,929.25 | -4,245,519.84 |
| 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） | 32,475,874.05 | 5,776,991.35 | 38,252,865.40 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 37,569,473.51 | 12,007,325.41 | 49,576,798.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -3,566,307.67 | -3,566,307.67 |
| 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) | -2,975,781.06 | -1,290,734.71 | -4,266,515.77 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,181,920.29 | 2,125,500.50 | 10,307,420.79 |
| 2.基金赎回款 | -11,157,701.35 | -3,416,235.21 | -14,573,936.56 |
| 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) | 34,593,692.45 | 7,150,283.03 | 41,743,975.48 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗凯

罗凯

高奇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德中小盘混合型证券投资基金(原名为诺德中小盘股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可号[2010]270号《关于核准诺德中小盘股票型证券投资基金募集的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 363,552,185.17 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 169 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 6 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 363,570,378.53 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,193.36 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司,基金托管人为中国银行

股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，诺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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 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%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期内未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|-------------------|
| 诺德基金管理有限公司（“诺德基金”） | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 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 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 284,209.40 | 318,771.84 |

| | | |
|-----------------|-----------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 97,121.59 | 106,499.03 |
|-----------------|-----------|------------|

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 47,368.26 | 53,128.67 |

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

不适用。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度可比期末，本基金其他关联方未持有本基金份额。

6.4.8.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 3,187,752.59 | 13,273.92 | 14,197,725.21 | 15,533.50 |

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 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 |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股未上市 | 3.46 | 3.46 | 1,000 | 3,460.00 | 3,460.00 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 34,906,820.00 | 88.73 |
| | 其中：股票 | 34,906,820.00 | 88.73 |
| 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 | 1,000,000.00 | 2.54 |
| | 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 | 3,300,487.57 | 8.39 |
| 8 | 其他各项资产 | 132,834.95 | 0.34 |
| 9 | 合计 | 39,340,142.52 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,649,560.00 | 4.31 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 16,665,140.00 | 43.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,546,500.00 | 4.04 |
| F | 批发和零售业 | 1,377,600.00 | 3.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 739,800.00 | 1.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,200,360.00 | 16.21 |
| J | 金融业 | 6,727,860.00 | 17.59 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 34,906,820.00 | 91.25 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 000001 | 平安银行 | 180,000 | 2,480,400.00 | 6.48 |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 34,000 | 2,347,700.00 | 6.14 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 18,000 | 2,123,100.00 | 5.55 |
| 4 | 002916 | 深南电路 | 19,000 | 1,936,480.00 | 5.06 |
| 5 | 002777 | 久远银海 | 71,500 | 1,880,450.00 | 4.92 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 22,000 | 1,778,260.00 | 4.65 |
| 7 | 600570 | 恒生电子 | 25,000 | 1,703,750.00 | 4.45 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 70,000 | 1,666,700.00 | 4.36 |
| 9 | 601336 | 新华保险 | 30,000 | 1,650,900.00 | 4.32 |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 46,000 | 1,649,560.00 | 4.31 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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 | 601336 | 新华保险 | 3,109,796.00 | 8.85 |
| 2 | 300349 | 金卡智能 | 2,357,375.00 | 6.71 |
| 3 | 000066 | 中国长城 | 2,174,588.00 | 6.19 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 2,099,859.00 | 5.98 |
| 5 | 002777 | 久远银海 | 2,065,040.00 | 5.88 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 1,994,050.00 | 5.68 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 1,953,218.00 | 5.56 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 1,927,574.00 | 5.49 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9 | 002916 | 深南电路 | 1,912,060.00 | 5.44 |
| 10 | 600996 | 贵广网络 | 1,850,136.00 | 5.27 |
| 11 | 002081 | 金螳螂 | 1,845,429.00 | 5.25 |
| 12 | 300498 | 温氏股份 | 1,815,014.80 | 5.17 |
| 13 | 002624 | 完美世界 | 1,782,291.00 | 5.07 |
| 14 | 600690 | 海尔智家 | 1,752,053.00 | 4.99 |
| 15 | 000686 | 东北证券 | 1,671,200.00 | 4.76 |
| 16 | 002024 | 苏宁易购 | 1,641,200.00 | 4.67 |
| 17 | 601222 | 林洋能源 | 1,609,330.00 | 4.58 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 1,587,800.00 | 4.52 |
| 19 | 603026 | 石大胜华 | 1,560,160.00 | 4.44 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 1,483,700.00 | 4.22 |
| 21 | 600745 | 闻泰科技 | 1,444,849.00 | 4.11 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 1,404,541.00 | 4.00 |
| 23 | 002475 | 立讯精密 | 1,290,270.00 | 3.67 |
| 24 | 002456 | 欧菲光 | 1,279,462.30 | 3.64 |
| 25 | 300059 | 东方财富 | 1,276,300.00 | 3.63 |
| 26 | 002371 | 北方华创 | 1,275,110.00 | 3.63 |
| 27 | 300502 | 新易盛 | 1,270,400.00 | 3.62 |
| 28 | 002304 | 洋河股份 | 1,208,619.00 | 3.44 |
| 29 | 000625 | 长安汽车 | 1,192,600.00 | 3.40 |
| 30 | 000401 | 冀东水泥 | 1,174,900.00 | 3.35 |
| 31 | 600643 | 爱建集团 | 1,171,600.00 | 3.34 |
| 32 | 600835 | 上海机电 | 1,130,200.00 | 3.22 |
| 33 | 002463 | 沪电股份 | 1,058,400.00 | 3.01 |
| 34 | 600570 | 恒生电子 | 1,048,303.99 | 2.98 |
| 35 | 601166 | 兴业银行 | 1,019,950.00 | 2.90 |
| 36 | 601128 | 常熟银行 | 1,011,000.00 | 2.88 |
| 37 | 002912 | 中新赛克 | 973,157.00 | 2.77 |
| 38 | 600498 | 烽火通信 | 916,494.00 | 2.61 |
| 39 | 300628 | 亿联网络 | 862,242.00 | 2.45 |
| 40 | 601555 | 东吴证券 | 793,000.00 | 2.26 |
| 41 | 002327 | 富安娜 | 788,533.00 | 2.25 |
| 42 | 600233 | 圆通速递 | 741,000.00 | 2.11 |
| 43 | 600271 | 航天信息 | 715,170.74 | 2.04 |
| 44 | 601377 | 兴业证券 | 714,000.00 | 2.03 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 300451 | 创业慧康 | 2,530,936.00 | 7.21 |
| 2 | 600643 | 爱建集团 | 2,418,016.00 | 6.88 |
| 3 | 002271 | 东方雨虹 | 2,243,250.00 | 6.39 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 2,161,900.00 | 6.16 |
| 5 | 002661 | 克明面业 | 2,115,405.00 | 6.02 |
| 6 | 600038 | 中直股份 | 2,086,443.00 | 5.94 |
| 7 | 603043 | 广州酒家 | 2,076,844.00 | 5.91 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 2,070,526.00 | 5.90 |
| 9 | 600872 | 中炬高新 | 2,013,462.00 | 5.73 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 2,000,000.00 | 5.69 |
| 11 | 300498 | 温氏股份 | 1,922,685.53 | 5.47 |
| 12 | 601939 | 建设银行 | 1,899,250.00 | 5.41 |
| 13 | 600690 | 海尔智家 | 1,870,286.22 | 5.32 |
| 14 | 600996 | 贵广网络 | 1,861,186.00 | 5.30 |
| 15 | 601336 | 新华保险 | 1,778,445.00 | 5.06 |
| 16 | 000686 | 东北证券 | 1,761,670.00 | 5.02 |
| 17 | 601186 | 中国铁建 | 1,684,003.00 | 4.79 |
| 18 | 002456 | 欧菲光 | 1,528,616.00 | 4.35 |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 1,525,479.00 | 4.34 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 1,517,783.00 | 4.32 |
| 21 | 601222 | 林洋能源 | 1,498,500.00 | 4.27 |
| 22 | 002594 | 比亚迪 | 1,461,244.00 | 4.16 |
| 23 | 002624 | 完美世界 | 1,460,200.00 | 4.16 |
| 24 | 601888 | 中国国旅 | 1,358,203.00 | 3.87 |
| 25 | 603026 | 石大胜华 | 1,325,082.60 | 3.77 |
| 26 | 300349 | 金卡智能 | 1,254,310.00 | 3.57 |
| 27 | 600835 | 上海机电 | 1,229,000.00 | 3.50 |
| 28 | 300502 | 新易盛 | 1,159,405.00 | 3.30 |
| 29 | 300059 | 东方财富 | 1,141,500.00 | 3.25 |
| 30 | 000002 | 万科 A | 1,107,201.00 | 3.15 |
| 31 | 002463 | 沪电股份 | 1,061,110.00 | 3.02 |
| 32 | 600104 | 上汽集团 | 1,055,200.00 | 3.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 33 | 000401 | 冀东水泥 | 1,043,000.00 | 2.97 |
| 34 | 600498 | 烽火通信 | 968,100.00 | 2.76 |
| 35 | 601555 | 东吴证券 | 932,497.00 | 2.65 |
| 36 | 002327 | 富安娜 | 850,000.00 | 2.42 |
| 37 | 601377 | 兴业证券 | 738,000.00 | 2.10 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 69,782,874.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 65,349,719.47 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

天津银监局于 2018 年 6 月 28 日根据中国银监会关于印发《节能减排授信工作指导意见》的通知》（银监发〔2007〕83 号）第五条，《中国银监会关于印发绿色信贷指引的通知》（银监发〔2012〕4 号）第十七条，《流动资金贷款管理暂行办法》第九条、第十三条、第三十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，认定平安银行贷款前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资，贷后管理失职，流动资金贷款被挪用，对其处以罚款人民币 50 万元。

中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日，认定平安银行在 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间，未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 40 万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；对平安银行合计处以 140 万元罚款。

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，新华保险（601336）的发行主体新华人寿保险股份有限公司（以下简称“公司”）存在被监管公开处罚的情形。中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 9 月 29 日因公司（一）欺骗投保人的行为违反《保险法》第一百一十六条，对公司罚款 30 万元；（二）是公司编制提供虚假资料的行为违反《保险法》第八十六条，根据该法第一百七十条，对公司罚款 50 万元；三是公司未按照规定使用经批准或者备案的保险费率的的行为违反《保险法》第一百三十五条，根据该法第一百七十条，对公司罚款 30 万元。

对平安银行的投资决策程序的说明：

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，多项处罚旨在规范公司各项业务，对上市公司长期经营和投资价值影响不大，我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和

公司制度的规定。

对新华保险的投资决策程序的说明：

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该项处罚针对事件主要发生在 2016 年 1 月至 2017 年 10 月期间，同时处罚力度对上市公司长期经营和投资价值影响不大，我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 23,225.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | 56,379.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 799.03 |
| 5 | 应收申购款 | 52,430.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 132,834.95 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 2,380 | 13,645.33 | 794.60 | 0.00% | 32,475,079.45 | 100.00% |

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 | 16,081.67 | 0.05% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 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（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 | 34,131,690.23 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,908,774.41 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,564,590.59 |
| 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 | 32,475,874.05 |

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本基金管理人 2019 年 5 月 25 日发布公告，严亚锋先生自 2019 年 5 月 24 日起担任公司首席信息官。本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

(2) 本基金托管人：2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2019 年度的基金审计机构。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供过 9 年的审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 方正证券 | 1 | 66,911,961.87 | 49.52% | 62,315.21 | 49.52% | - |
| 中信证券 | 2 | 47,928,954.74 | 35.47% | 44,635.99 | 35.47% | - |
| 海通证券 | 1 | 16,051,258.81 | 11.88% | 14,948.73 | 11.88% | - |
| 东北证券 | 1 | 3,066,369.00 | 2.27% | 2,855.72 | 2.27% | - |
| 招商证券 | 1 | 1,157,550.00 | 0.86% | 1,077.99 | 0.86% | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 大同证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 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、安全通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | 45,000,000.00 | 48.91% | - | - |
| 海通证券 | - | - | 46,000,000.00 | 50.00% | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | 1,000,000.00 | 1.09% | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 大同证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

诺德基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日