

诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	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真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61

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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺德新宜
基金主代码	005294
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 12 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	461,721,590.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过不同投资资产类别之间的灵活配置，综合运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金以对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究为基础，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，对基金资产进行灵活资产配置，在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈培阳	郑鹏
	联系电话	021-68985266	010-85238667
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		400-888-0009	95577
传真		021-68985121	010-85238680
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码	200120	100005
法定代表人	潘福祥	李民吉

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	25,019,716.70
本期利润	19,233,475.62
加权平均基金份额本期利润	0.0454
本期加权平均净值利润率	3.62%
本期基金份额净值增长率	3.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	127,625,987.24
期末可供分配基金份额利润	0.2764
期末基金资产净值	589,347,577.92
期末基金份额净值	1.2764
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	27.64%

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 2018 年 1 月 12 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

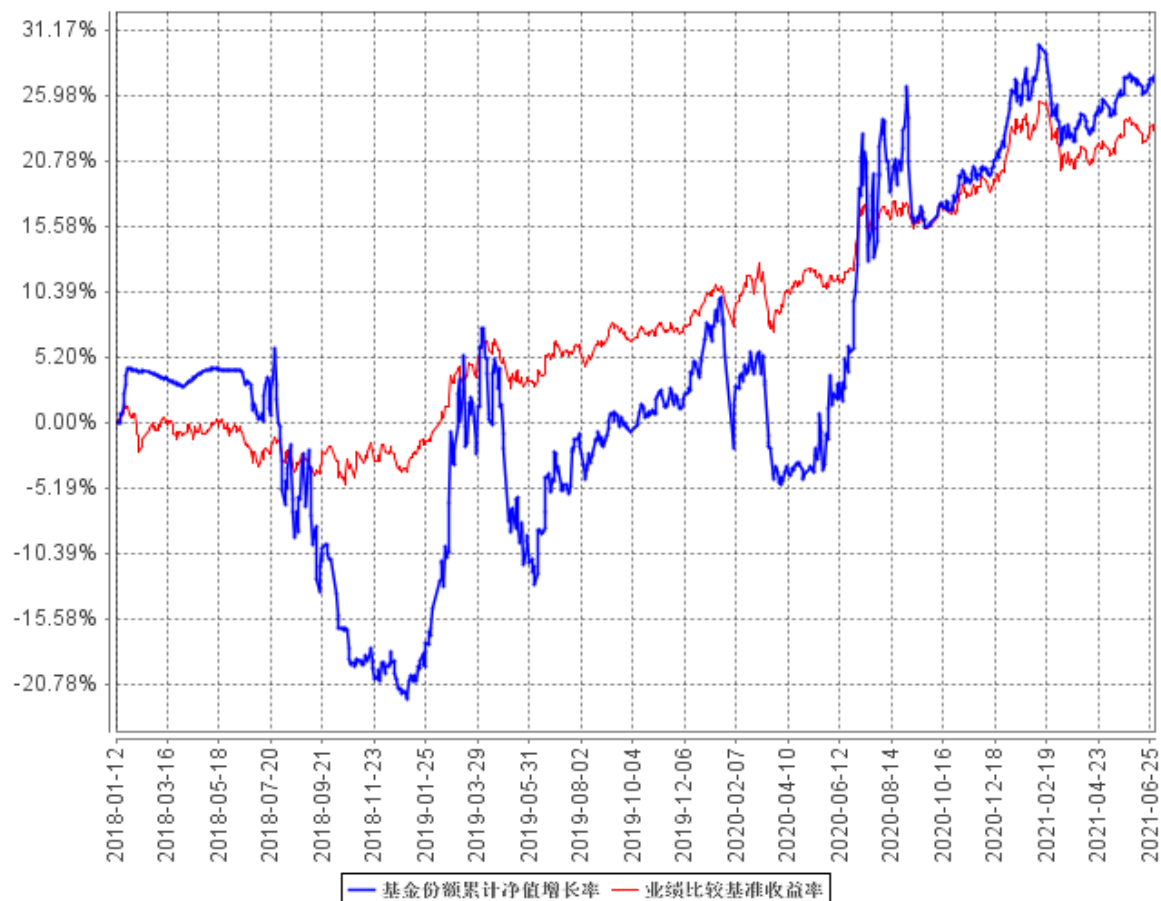
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.09%	0.24%	-0.47%	0.25%	0.56%	-0.01%
过去三个月	3.28%	0.31%	2.02%	0.30%	1.26%	0.01%
过去六个月	3.34%	0.48%	1.90%	0.40%	1.44%	0.08%
过去一年	16.39%	0.96%	9.66%	0.40%	6.73%	0.56%
过去三年	25.84%	1.20%	26.42%	0.40%	-0.58%	0.80%
自基金合同	27.64%	1.12%	23.53%	0.39%	4.11%	0.73%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：业绩比较基准=中证全债指数*70%+沪深 300 指数收益率*30%

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：本基金合同于 2018 年 1 月 12 日生效，图示时间段为 2018 年 1 月 12 日至 2021 年 6 月 30 日。

本基金建仓期为 2018 年 1 月 12 日至 2018 年 7 月 11 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾钰	本基金基金经理、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混	2018 年 6 月 9 日	-	10	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。

	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的基金经理				
--	---------------------------------	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2021 年上半年，上证综指震荡上行，最终上涨 3.40%。指数普涨，沪深 300 指数、创业板指数和科创板指数分别上涨 0.24%、17.22% 和 14.01%。从行业角度来看，钢铁、电气设备和化工领涨，非银金融、家电和农业领跌。

本基金秉承“在控制风险的前提下，坚持长期投资，保持低换手率”的投资风格。在权益投资方面，自上而下选择行业，自下而上选择个股，以景气度高、核心竞争力强、估值合理甚至低估的优质公司为主。在固收投资方面，精选高景气行业的高评级信用债以及利率债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2764 元，累计净值为 1.2764 元。本报告期份额净值增长率为 3.34%，同期业绩比较基准增长率为 1.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前各国处于疫苗注射阶段，同时部分国家出现疫情的反复，我国少数城市也出现疫情但相对可控，属于疫苗和疫情赛跑的后疫情时代。全球经济正在从疫情中恢复，企业盈利改善从数据中持续得到确认。今年流动性相对去年边际收紧，但出现快速剧烈收紧的概率也不大。目前对于美债收益率上升和大宗商品价格上涨的担忧逐渐缓解，市场风险偏好处于相对高位。在春节后的一轮市场调整之后，高估值的压力有所释放，基本面优秀并且业绩确定性和持续性强的优质公司有望成为市场重点配置的方向。

从中长期来看，我国金融开放的力度加大，外资持续流入的趋势不变。国内“房住不炒”的思路延续，叠加理财产品打破刚兑，居民投资面临“资产荒”，权益市场有望承接居民资产配置的需求。结构方面，中长期看好景气度向上的细分行业，如消费、医药、高端制造等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资研究部总监、

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

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

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	12,198,046.54	2,488,790.87
结算备付金		14,871.23	17,614.76
存出保证金		150,765.46	270,807.35
交易性金融资产	6.4.7.2	572,918,051.50	611,991,680.16
其中：股票投资		143,540,051.50	183,083,680.16
基金投资		-	-
债券投资		429,378,000.00	428,908,000.00
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	7,700,000.00	32,040,134.57
应收证券清算款		268,944.94	221,050.18
应收利息	6.4.7.5	3,623,930.53	3,170,273.04
应收股利		-	-
应收申购款		159.79	169.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		596,874,769.99	650,200,520.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,063,228.48	170.25
应付赎回款		4,614.08	119,161.76
应付管理人报酬		262,540.98	344,494.20
应付托管费		43,756.83	57,415.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,003.25	154,070.41
应交税费		13,860.58	8,273.30

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,187.87	140,001.44
负债合计		7,527,192.07	823,587.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	461,721,590.68	525,770,450.71
未分配利润	6.4.7.10	127,625,987.24	123,606,482.92
所有者权益合计		589,347,577.92	649,376,933.63
负债和所有者权益总计		596,874,769.99	650,200,520.69

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2764 元，基金份额总额 461,721,590.68 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		21,603,431.41	-1,254,693.24
1.利息收入		4,329,465.03	15,331.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	134,263.42	15,331.50
债券利息收入		4,078,464.25	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		116,737.36	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,331,654.04	4,737,206.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,407,318.23	4,825,648.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	884,592.77	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,039,743.04	-88,442.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,786,241.08	-6,122,565.37
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	728,553.42	115,334.16
减：二、费用		2,369,955.79	299,392.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,586,775.11	53,864.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	264,462.49	8,977.33

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	375,111.61	166,934.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,927.63	-
7. 其他费用	6.4.7.20	134,678.95	69,616.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,233,475.62	-1,554,085.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,233,475.62	-1,554,085.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	525,770,450.71	123,606,482.92	649,376,933.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,233,475.62	19,233,475.62
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）	-64,048,860.03	-15,213,971.30	-79,262,831.33
其中：1.基金申购款	204,425,385.17	53,116,608.38	257,541,993.55
2.基金赎回款	-268,474,245.20	-68,330,579.68	-336,804,824.88
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）	461,721,590.68	127,625,987.24	589,347,577.92
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	63,841,862.91	4,251,193.08	68,093,055.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,554,085.97	-1,554,085.97
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)	-61,192,631.07	-2,441,020.89	-63,633,651.96
其中：1.基金申购款	843,390.93	3,901.81	847,292.74
2.基金赎回款	-62,036,022.00	-2,444,922.70	-64,480,944.70
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)	2,649,231.84	256,086.22	2,905,318.06

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

基金管理人负责人

罗凯

主管会计工作负责人

高奇

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]633号《关于准予诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集205,080,754.30元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,087,826.31份基金份额,其中认购资金利息折合7,072.01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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

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<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德新宜灵活配置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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	12,198,046.54
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：	12,198,046.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,509,600.21	143,540,051.50	20,030,451.29
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	428,958,625.32	419,374.68
	合计	428,958,625.32	419,374.68
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	552,468,225.53	572,918,051.50	20,449,825.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,700,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,528.91
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	6.70
应收债券利息	3,608,327.12
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	67.80
合计	3,623,930.53

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	37,103.25
银行间市场应付交易费用	2,900.00
合计	40,003.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.92
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
合计	99,187.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	525,770,450.71	525,770,450.71
本期申购	204,425,385.17	204,425,385.17
本期赎回(以“-”号填列)	-268,474,245.20	-268,474,245.20
- 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	461,721,590.68	461,721,590.68

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	156,842,104.68	-33,235,621.76	123,606,482.92
本期利润	25,019,716.70	-5,786,241.08	19,233,475.62

本期基金份额交易产生的变动数	-17,092,812.25	1,878,840.95	-15,213,971.30
其中：基金申购款	67,254,447.77	-14,137,839.39	53,116,608.38
基金赎回款	-84,347,260.02	16,016,680.34	-68,330,579.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,769,009.13	-37,143,021.89	127,625,987.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	124,140.79
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	1,224.00
其他	8,898.63
合计	134,263.42

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	135,191,746.75
减：卖出股票成本总额	114,784,428.52
买卖股票差价收入	20,407,318.23

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	474,469,486.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	467,952,295.87
减：应收利息总额	5,632,597.82
买卖债券差价收入	884,592.77

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,039,743.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,039,743.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,786,241.08
—— 股票投资	-5,259,401.22
—— 债券投资	-526,839.86
—— 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	-5,786,241.08

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	728,553.42
合计	728,553.42

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金对持续持有基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于 30 日（含）但少于 90 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有基金份额长于 90 日（含）但少于 180 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产。

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	369,461.61
银行间市场交易费用	5,650.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	375,111.61

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	59,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行间债券账户维护费	15,500.00
合计	134,678.95

6.4.7.21 分部报告

不适用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司（诺德基金）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司（华夏银行）	基金托管人、基金代销机构
清华控股有限公司（清华控股）	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理(北京)有限公司(宜信惠民)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,586,775.11	53,864.06
其中：支付销售机构的客户维护费	78,853.43	3,141.11

注：支付基金管理人诺德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	264,462.49	8,977.33

注：支付基金托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2018年	-	-

1 月 12 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	1,922,892.03	1,922,892.03
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	1,922,892.03	-
报告期末持有的基金份额	0.00	1,922,892.03
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	72.58%

基金管理人诺德基金在本报告期赎回本基金的交易通过诺德基金管理有限公司直销机构办理, 赎回费人民币 0.00 元。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	12,198,046.54	124,140.79	244,344.30	14,450.80

注: 本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 (2021 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位：	期末 成本总额	期末估值总 额	备注

							股)			
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

			10 日							
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	47.33	251.96	303	14,340.99	76,343.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

			日							
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	416	13,819.52	36,400.00	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,684.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688067	爱威科技	2021 年 6 月 7 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688079	美迪凯	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 2 日	新股流通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688087	英科	2021 年	2021	新股未	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

	再生	6月30日	年7月9日	上市						
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股流通受限	36.35	79.48	2,413	87,712.55	191,785.24	-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月4日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688606	奥泰生物	2021年3月17日	2021年9月26日	新股流通受限	133.67	139.31	1,351	180,588.17	188,207.81	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

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

售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与持有转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：（1）决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；（2）执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活

动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；（3）监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、稽核风控部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华夏银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	10,029,000.00	118,719,000.00

A-1 以下	—	—
未评级	328,688,000.00	260,099,000.00
合计	338,717,000.00	378,818,000.00

注：未评级为政策性金融债、短期融资券及同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	90,661,000.00	—
AAA 以下	—	—
未评级	—	50,090,000.00
合计	90,661,000.00	50,090,000.00

注：未评级为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资

产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,198,046.54	-	-	-	-	-	12,198,046.54
结算备	14,871.23	-	-	-	-	-	14,871.23

付金							
存出保证金	150,765.46	-	-	-	-	-	150,765.46
交易性金融资产	-239,282,000.00	129,685,000.00	60,411,000.00	-143,540,051.50	572,918,051.50		
买入返售金融资产	7,700,000.00	-	-	-	-	7,700,000.00	
应收证券清算款	-	-	-	-	268,944.94	268,944.94	
应收利息	-	-	-	-	3,623,930.53	3,623,930.53	
应收申购款	-	-	-	-	159.79	159.79	
资产总计	20,063,683.23	239,282,000.00	129,685,000.00	60,411,000.00	-147,433,086.76	596,874,769.99	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	7,063,228.48	7,063,228.48	
应付赎回款	-	-	-	-	4,614.08	4,614.08	
应付管理人报酬	-	-	-	-	262,540.98	262,540.98	
应付托管费	-	-	-	-	43,756.83	43,756.83	
应付交易费用	-	-	-	-	40,003.25	40,003.25	
应交税费	-	-	-	-	13,860.58	13,860.58	
其他负债	-	-	-	-	99,187.87	99,187.87	
负债总计	-	-	-	-	7,527,192.07	7,527,192.07	
利率敏感度缺口	20,063,683.23	239,282,000.00	129,685,000.00	60,411,000.00	-139,905,894.69	589,347,577.92	
上年度末 2020 年 12 月 31	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

日							
资产							
银行存款	2,488,790.87	-	-	-	-	-	2,488,790.87
结算备付金	17,614.76	-	-	-	-	-	17,614.76
存出保证金	270,807.35	-	-	-	-	-	270,807.35
交易性金融资产	29,925,000.00	288,842,000.00	110,141,000.00	-	-	-183,083,680.16	611,991,680.16
买入返售金融资产	32,040,134.57	-	-	-	-	-	32,040,134.57
应收证券清算款	-	-	-	-	-	221,050.18	221,050.18
应收利息	-	-	-	-	-	3,170,273.04	3,170,273.04
应收申购款	-	-	-	-	-	169.76	169.76
资产总计	64,742,347.55	288,842,000.00	110,141,000.00	-	-	-186,475,173.14	650,200,520.69
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	170.25	170.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	119,161.76	119,161.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	344,494.20	344,494.20
应付托管费	-	-	-	-	-	57,415.70	57,415.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	154,070.41	154,070.41
应交税费	-	-	-	-	-	8,273.30	8,273.30
其他负债	-	-	-	-	-	140,001.44	140,001.44
负债总计	-	-	-	-	-	823,587.06	823,587.06
利率敏感度缺	64,742,347.55	288,842,000.00	110,141,000.00	-	-	-185,651,586.08	649,376,933.63

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	667,816.97	268,268.55
	市场利率上升 25 个基点	-663,254.83	-267,866.45

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不

包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	143,540,051.50	24.36	183,083,680.16	28.19
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	143,540,051.50	24.36	183,083,680.16	28.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	11,380,301.73	20,017,043.98
	沪深 300 指数下降 5%	-11,380,301.73	-20,017,043.98

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	143,540,051.50	24.05
	其中：股票	143,540,051.50	24.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	429,378,000.00	71.94
	其中：债券	429,378,000.00	71.94
	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	7,700,000.00	1.29
	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	12,212,917.77	2.05
8	其他各项资产	4,043,800.72	0.68
9	合计	596,874,769.99	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	1,509,349.46	0.26
C	制造业	77,245,244.27	13.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,241,100.39	0.21
E	建筑业	1,063,556.38	0.18
F	批发和零售业	95,577.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,139,000.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,441,033.10	0.58
J	金融业	36,608,278.93	6.21
K	房地产业	555,501.52	0.09
L	租赁和商务服务业	6,497,713.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	7,045,424.72	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,670,543.54	0.96
R	文化、体育和娱乐业	1,372,000.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	143,540,051.50	24.36

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	400,000	9,048,000.00	1.54
2	600519	贵州茅台	4,300	8,843,810.00	1.50
3	300750	宁德时代	16,000	8,556,800.00	1.45
4	000661	长春高新	17,300	6,695,100.00	1.14
5	000858	五粮液	22,300	6,642,947.00	1.13
6	603259	药明康德	41,880	6,557,989.20	1.11
7	601888	中国中免	16,500	4,951,650.00	0.84
8	000333	美的集团	61,099	4,360,635.63	0.74
9	601318	中国平安	63,000	4,049,640.00	0.69
10	601166	兴业银行	194,300	3,992,865.00	0.68
11	600036	招商银行	73,100	3,961,289.00	0.67
12	300015	爱尔眼科	44,473	3,156,693.54	0.54
13	000568	泸州老窖	11,600	2,736,904.00	0.46
14	300124	汇川技术	36,000	2,673,360.00	0.45
15	600276	恒瑞医药	35,640	2,422,450.80	0.41
16	300760	迈瑞医疗	5,000	2,400,250.00	0.41
17	601012	隆基股份	26,460	2,350,706.40	0.40
18	300059	东方财富	62,400	2,046,096.00	0.35
19	002415	海康威视	29,300	1,889,850.00	0.32
20	600763	通策医疗	4,000	1,644,000.00	0.28
21	600030	中信证券	65,900	1,643,546.00	0.28
22	603799	华友钴业	14,000	1,598,800.00	0.27
23	002027	分众传媒	164,300	1,546,063.00	0.26
24	600690	海尔智家	55,400	1,435,414.00	0.24
25	000725	京东方 A	220,200	1,374,048.00	0.23

26	300413	芒果超媒	20,000	1,372,000.00	0.23
27	603589	口子窖	20,000	1,353,800.00	0.23
28	601398	工商银行	254,418	1,315,341.06	0.22
29	601689	拓普集团	35,000	1,310,050.00	0.22
30	600309	万华化学	11,700	1,273,194.00	0.22
31	600900	长江电力	59,500	1,228,080.00	0.21
32	600754	锦江酒店	20,000	1,139,000.00	0.19
33	600031	三一重工	38,966	1,132,741.62	0.19
34	600436	片仔癀	2,300	1,031,090.00	0.17
35	601328	交通银行	204,346	1,001,295.40	0.17
36	002304	洋河股份	4,800	994,560.00	0.17
37	300122	智飞生物	5,100	952,323.00	0.16
38	002142	宁波银行	22,900	892,413.00	0.15
39	600000	浦发银行	87,748	877,480.00	0.15
40	600438	通威股份	20,200	874,054.00	0.15
41	300347	泰格医药	4,500	869,850.00	0.15
42	600837	海通证券	75,100	863,650.00	0.15
43	000100	TCL 科技	109,400	836,910.00	0.14
44	002230	科大讯飞	12,300	831,234.00	0.14
45	002241	歌尔股份	17,900	765,046.00	0.13
46	600585	海螺水泥	18,300	751,215.00	0.13
47	000063	中兴通讯	22,600	750,998.00	0.13
48	603986	兆易创新	3,920	736,568.00	0.12
49	300014	亿纬锂能	7,000	727,510.00	0.12
50	601668	中国建筑	155,993	725,367.45	0.12
51	601688	华泰证券	45,700	722,060.00	0.12
52	002271	东方雨虹	12,900	713,628.00	0.12
53	603317	天味食品	24,000	706,320.00	0.12
54	600016	民生银行	156,377	689,622.57	0.12
55	601899	紫金矿业	68,850	667,156.50	0.11
56	600570	恒生电子	7,100	662,075.00	0.11
57	601288	农业银行	201,401	610,245.03	0.10
58	601211	国泰君安	35,200	603,328.00	0.10
59	000338	潍柴动力	33,500	598,645.00	0.10
60	601766	中国中车	94,800	576,384.00	0.10
61	601601	中国太保	19,800	573,606.00	0.10
62	601229	上海银行	67,920	556,944.00	0.09
63	600048	保利地产	46,138	555,501.52	0.09
64	600406	国电南瑞	23,760	552,182.40	0.09

65	600999	招商证券	28,200	536,364.00	0.09
66	600919	江苏银行	72,515	514,856.50	0.09
67	002129	中环股份	13,300	513,380.00	0.09
68	000538	云南白药	4,300	497,596.00	0.08
69	688131	皓元医药	1,408	487,435.52	0.08
70	000596	古井贡酒	2,000	479,000.00	0.08
71	002410	广联达	7,000	477,400.00	0.08
72	601169	北京银行	94,901	462,167.87	0.08
73	600028	中国石化	102,400	446,464.00	0.08
74	600588	用友网络	13,200	439,032.00	0.07
75	601088	中国神华	20,273	395,728.96	0.07
76	002493	荣盛石化	22,500	388,575.00	0.07
77	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.06
78	002001	新和成	13,080	375,134.40	0.06
79	601988	中国银行	119,292	367,419.36	0.06
80	601818	光大银行	93,868	354,821.04	0.06
81	002007	华兰生物	9,500	348,460.00	0.06
82	000776	广发证券	22,200	336,108.00	0.06
83	000166	申万宏源	70,600	330,408.00	0.06
84	603179	新泉股份	10,000	328,800.00	0.06
85	601390	中国中铁	61,800	323,832.00	0.05
86	002236	大华股份	15,300	322,830.00	0.05
87	600050	中国联通	74,100	320,112.00	0.05
88	300433	蓝思科技	10,700	314,687.00	0.05
89	600600	青岛啤酒	2,700	312,255.00	0.05
90	601989	中国重工	75,600	311,472.00	0.05
91	000895	双汇发展	9,100	289,380.00	0.05
92	600132	重庆啤酒	1,200	237,540.00	0.04
93	000783	长江证券	30,600	223,992.00	0.04
94	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.03
95	688276	百克生物	2,413	191,785.24	0.03
96	688606	奥泰生物	1,351	188,207.81	0.03
97	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
98	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
99	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.02
100	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
101	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.02
102	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
103	300957	贝泰妮	303	76,343.88	0.01

104	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
105	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
106	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
107	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
108	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
109	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
110	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
111	300894	火星号	628	42,704.00	0.01
112	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
113	300979	华利集团	416	36,400.00	0.01
114	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
115	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.01
116	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
117	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
118	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
119	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
120	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
121	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
122	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
123	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
124	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
125	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
126	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
127	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
128	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
129	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
130	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
131	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
132	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
133	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
134	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
135	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
136	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
137	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
138	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
139	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
140	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
141	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
142	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

143	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
144	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
145	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
146	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
147	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
148	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
149	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
150	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
151	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
152	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
153	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
154	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
155	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
156	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
157	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
158	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
159	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
160	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
161	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
162	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
163	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
164	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
165	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
166	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
167	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
168	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
169	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
170	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
171	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	7,456,379.35	1.15
2	601166	兴业银行	7,238,227.50	1.11

3	600660	福耀玻璃	5,922,067.00	0.91
4	601888	中国中免	5,506,317.40	0.85
5	300750	宁德时代	5,290,633.00	0.81
6	601318	中国平安	4,958,707.00	0.76
7	603259	药明康德	4,423,852.00	0.68
8	601633	长城汽车	4,241,144.00	0.65
9	600519	贵州茅台	3,505,370.00	0.54
10	002460	赣锋锂业	2,864,039.25	0.44
11	600104	上汽集团	2,675,562.93	0.41
12	300760	迈瑞医疗	2,074,936.00	0.32
13	300124	汇川技术	1,671,576.00	0.26
14	000661	长春高新	1,643,083.00	0.25
15	300144	宋城演艺	1,613,293.00	0.25
16	600763	通策医疗	1,603,990.00	0.25
17	601689	拓普集团	1,599,881.00	0.25
18	300413	芒果超媒	1,487,123.00	0.23
19	300015	爱尔眼科	1,450,878.80	0.22
20	603799	华友钴业	1,318,011.20	0.20

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	002594	比亚迪	16,856,304.54	2.60
2	600104	上汽集团	8,916,585.00	1.37
3	600660	福耀玻璃	7,503,640.56	1.16
4	601633	长城汽车	7,102,914.30	1.09
5	601318	中国平安	5,554,344.50	0.86
6	002352	顺丰控股	5,392,450.25	0.83
7	601166	兴业银行	5,144,589.00	0.79
8	601888	中国中免	4,539,215.58	0.70
9	000651	格力电器	4,270,001.00	0.66
10	300750	宁德时代	4,216,629.52	0.65
11	600009	上海机场	4,153,383.23	0.64
12	300413	芒果超媒	3,888,922.00	0.60
13	002812	恩捷股份	3,611,867.45	0.56

14	603486	科沃斯	3,450,485.61	0.53
15	002050	三花智控	3,208,265.37	0.49
16	600196	复星医药	3,206,301.22	0.49
17	002475	立讯精密	3,068,313.50	0.47
18	300999	金龙鱼	2,862,380.17	0.44
19	600741	华域汽车	2,411,179.16	0.37
20	002460	赣锋锂业	2,265,169.01	0.35

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	80,500,201.08
卖出股票收入（成交）总额	135,191,746.75

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,022,000.00	8.49
	其中：政策性金融债	30,018,000.00	5.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	210,343,000.00	35.69
6	中期票据	70,657,000.00	11.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	98,356,000.00	16.69
9	其他	-	-
10	合计	429,378,000.00	72.86

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112113044	21 浙商银行 CD044	800,000	78,920,000.00	13.39
2	210201	21 国开 01	300,000	30,018,000.00	5.09
3	101900630	19 京国资	200,000	20,182,000.00	3.42

		MTN001			
4	101901449	19 汇金 MTN017	200,000	20,152,000.00	3.42
5	012004039	20 南京地铁 SCP011	200,000	20,080,000.00	3.41

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中, 21 浙商银行 CD044 的发行主体浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)存在被监管公开处罚的情形。

1、21 浙商银行 CD044

根据 2020 年 7 月 13 日的行政处罚决定, 因招商银行: (一) 关联交易未经关联交易委员会审

批；（二）未严格执行关键岗位轮岗制度；（三）对上海分行理财业务授权混乱；（四）以保险类资产管理公司为通道，违规将存放同业款项倒存为一般性存款；（五）通过保险资管计划协助他行将存放同业款项转为一般性存款；（六）通过投资他行一般企业存单收益权的方式为他行虚增一般性存款；（七）以投资虚假底层债权并要求客户以存单质押的方式虚增存款；（八）黄金租赁业务未按监管要求计提风险加权资产；（九）不良资产虚假出表；（十）信贷资产虚假转让，违规削减信贷规模；（十一）向资金掮客销售私募信贷资产证券化产品次级份额，并以该次级份额受益权为质押溢价开立信用证；（十二）向资金掮客虚假代销信托产品，并以代销的信托产品收益权质押开立无真实贸易背景的信用证；（十三）债券主承销业务未按规定纳入统一授信管理；（十四）为个人提供以股票质押的融资不审慎；（十五）违规向客户提供融资用于参与定向增发；（十六）通过同业票据不当交易规避信贷规模管控；（十七）违规以投资代替贴现，少计风险加权资产；（十八）以类资产证券化方式开展信贷资产转让，少计风险加权资产；（十九）以存放同业质押并指令交易对手以委托投资的方式收购本行资产，实现资产虚假出表；（二十）向他行卖出债券并承诺回购，少计风险加权资产；（二十一）通过特殊目的载体向他行存款并提供质押担保，由他行向本行授信客户提供融资；（二十二）同业投资接受金融机构回购承诺；（二十三）购买银行违规发行的同业委托投资计划用于承接该银行资产，并接受信用担保；（二十四）同业投资承接他行资产并接受他行存单质押担保；（二十五）通过违规发售理财产品实现本行资产虚假出表；（二十六）通过违规发售理财产品帮助交易对手实现资产虚假出表；（二十七）转让理财资产违规提供回购承诺；（二十八）理财资金违规用于保险公司增资；（二十九）违规向土地储备机构融资；（三十）向房地产开发企业提供融资，用于偿还股东垫付的土地出让金；（三十一）通过理财非标投资向房地产开发企业提供融资，用于缴纳土地出让金，被中国银行保险监督管理委员会罚款 10120 万元。

对 21 浙商银行 CD044 的投资决策程序的说明：

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	150,765.46
2	应收证券清算款	268,944.94
3	应收股利	-
4	应收利息	3,623,930.53
5	应收申购款	159.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,043,800.72

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
527	876,132.05	461,554,207.80	99.96%	167,382.87	0.04%

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	10.18	0.00%

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（ 2018 年 1 月 12 日 ）基金份额总额	205,087,826.31
本报告期期初基金份额总额	525,770,450.71
本报告期基金总申购份额	204,425,385.17
减：本报告期基金总赎回份额	268,474,245.20
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	461,721,590.68

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 本报告期内，本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内继续聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2021 年度的基金审计机构，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 3 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	
海通证券	1	118,046,600.07	56.78%	109,935.34	56.78%	-
中信证券	1	89,862,836.11	43.22%	83,689.58	43.22%	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

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

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	13,400,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
2	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 1 月 22 日
3	诺德基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 2 月 8 日
4	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司申购（含定期定额投资）、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 2 月 23 日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 10 日
6	诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日

7	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 3 月 30 日
8	诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
9	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
10	诺德基金管理有限公司关于调整微信网上直销业务优惠费率的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
11	诺德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 24 日
12	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国人寿保险股份有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 18 日
13	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富（上海）基金销售有限公司 申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 29 日
14	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京虹点基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 19 日
15	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京度小满基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日
16	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海爱建基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内没有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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

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

诺德基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日