

# 诺德主题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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>

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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺德主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺德灵活配置混合
基金主代码	571002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 11 月 5 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,055,632.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注中国在经济崛起过程中带来的结构性变化，及时把握宏观投资趋势，通过准确的主题配置和精选个股，追求资产长期稳定的增值，在有效控制风险的前提下为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	<p>本基金深刻分析影响国家经济发展和企业盈利的关键和趋势性因素，及时把握中国经济崛起过程中主题演变带来的投资机会，强调对上市公司基本面的深入研究，精心挑选主题演变中的优势企业。充分挖掘企业的投资价值基础上，确保一定的安全边际，进行中长期投资。</p> <p>本基金重视自上而下的主题发掘，通过对宏观经济中制度性、结构性或周期性发展趋势的研究，把握中国经济崛起的产业变迁，从而了解中国产业演进的趋势，寻找到中长期发展趋势良好的企业。本基金管理人认为：和谐社会、自主创新、产业升级、消费升级将是与中国经济崛起相关度最大的四大主题，将这四大主题贯彻到研究中，以此确立投资的重点领域。</p>
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为偏股型的混合型基金，风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	陈培阳	李申

人	联系电话	021-68985266	021-60637102
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0009	021-60637111
传真		021-68985121	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
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	《证券时报》
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	2,773,789.53
本期利润	5,669,918.99
加权平均基金份额本期利润	0.1255
本期加权平均净值利润率	7.48%
本期基金份额净值增长率	7.67%
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	33,937,250.93
期末可供分配基金份额利润	0.7532
期末基金资产净值	78,992,883.80
期末基金份额净值	1.7532
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	269.25%

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 2008 年 11 月 5 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	-0.84%	0.87%	-1.15%	0.49%	0.31%	0.38%
过去三个月	9.04%	1.02%	2.49%	0.59%	6.55%	0.43%
过去六个月	7.67%	1.29%	1.06%	0.79%	6.61%	0.50%
过去一年	18.35%	1.29%	16.29%	0.80%	2.06%	0.49%
过去三年	51.88%	1.29%	35.49%	0.82%	16.39%	0.47%
自基金合同	269.25%	1.40%	163.43%	0.92%	105.82%	0.48%

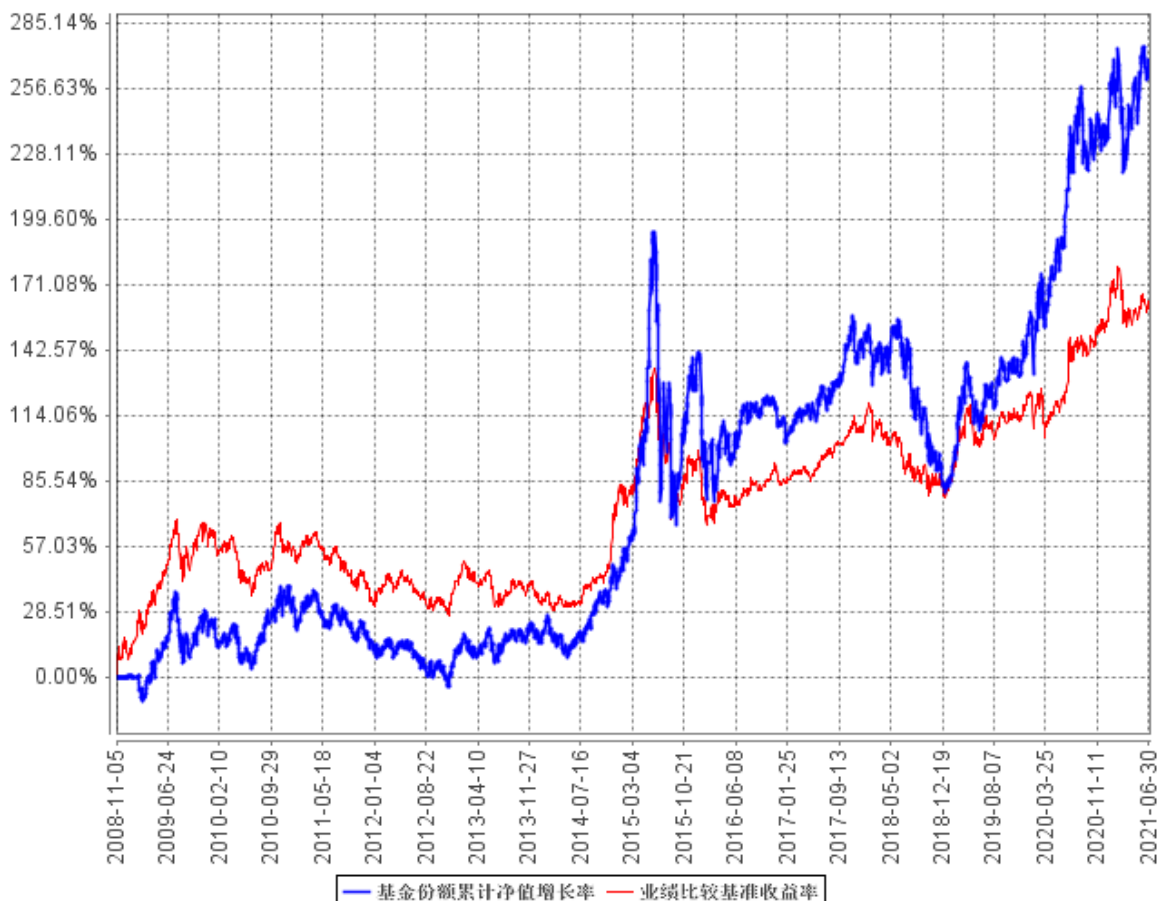


生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：业绩比较基准=沪深 300 指数\*60%+上证国债指数\*40%

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

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 2008 年 11 月 5 日，图示时间段为 2008 年 11 月 5 日至 2021 年 6 月 30 日。本基金建仓期间自 2008 年 11 月 5 日至 2009 年 5 月 4 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		
朱红	本基金基金经理、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经	2014 年 4 月 1 日	-	13	大连理工大学工商管理硕士。2007 年 8 月至 2009 年 10 月在新华基金管理有限公司投资管理部担任投资总监助理、基金经理助理。2009 年 11 月加入诺德至今，先后担任投资研究部高级研究员、基金经理助理职务。现任投资总监，具有基金从业资格。

	理、诺德 优势产 业混合 型证券 投资基 金基金 经理、投 资总监				
--	--	--	--	--	--

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 年上半年宏观经济处于复苏过程中，出口表现强势，大宗商品价格涨幅较大，部分下游制造业面临较大的成本压力。虽然外部国际环境具有一定的不确定性，但我国保持战略定力，集中精力做好自己的事，长期来看宏观经济处于转型升级、向高质量发展的这一趋势不会改变，受到政策支持的如高端制造、半导体等行业或将面临较好的发展机遇。

从流动性看，财政货币政策逐渐回归中性，投资者更加关注业绩增长的持续性和估值的匹配，一旦业绩增速低于预期，前期涨幅较大的行业个股将面临较大的调整压力，市场结构分化剧烈，具体到细分行业来看，表现较好的是新能源、钢铁、化工等板块，非银金融、家电的等跌幅较大。

上半年本基金采取了“自下而上精选确定性成长个股”的配置格局，适当加大了医药行业个股的配置力度。

##### 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 1.7532 元，累计净值为 3.0232 元。本报告期份额净值增长率为 7.67%，同期业绩比较基准增长率为 1.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济仍处于转型升级的大背景下，受政策支持的芯片、新能源等行业快速发展，相关上下游产业链面临较好的发展机遇，充分享受行业增长红利。但受政策影响，如近期一些针对教育培训行业的相关政策的推出，部分行业也面临一定的政策风险，具有较大的不确定性，未来的市场仍然会结构分化。在这一时代背景下，需要进一步加强对相关行业的产业政策研究，保持对相关政策的敏感性，精选长期发展前景明确、行业竞争格局清晰、受政策风险扰动较小的优质公司。相信这类具有核心竞争力的优质企业可以凭借技术、品牌、渠道等优势进一步扩大市场份额，强者恒强，获得可持续的成长。随着半年报的披露，后续将积极关注部分业绩超预期的优质公司。

本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度，精选业绩可持续发展的优质公司，力争获得良好的长期收益。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：诺德主题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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,282,654.11	2,741,402.10
结算备付金		193,628.10	320,637.86
存出保证金		17,966.42	45,513.81
交易性金融资产	6.4.7.2	72,093,141.19	66,198,396.41
其中：股票投资		62,191,561.25	58,737,576.78
基金投资		-	-
债券投资		9,901,579.94	7,460,819.63
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	5,000,000.00	5,000,000.00
应收证券清算款		462,154.67	1,292,141.60
应收利息	6.4.7.5	52,369.50	92,082.70
应收股利		-	-
应收申购款		38,713.69	52,315.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		85,140,627.68	75,742,490.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,910,919.05	1,283,974.26
应付赎回款		6,568.83	12,272.88
应付管理人报酬		97,171.93	119,202.19
应付托管费		16,195.31	19,867.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	47,442.20	58,624.88
应交税费		12.43	38.33

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	69,434.13	60,027.82
负债合计		6,147,743.88	1,554,007.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	45,055,632.87	45,560,653.20
未分配利润	6.4.7.10	33,937,250.93	28,627,829.85
所有者权益合计		78,992,883.80	74,188,483.05
负债和所有者权益总计		85,140,627.68	75,742,490.44

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7532 元，基金份额总额 45,055,632.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺德主题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
<b>一、收入</b>		6,601,354.29	23,474,806.68
1.利息收入		74,702.33	110,012.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,858.29	58,801.19
债券利息收入		34,137.58	37,125.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,706.46	14,085.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,627,392.74	7,939,259.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,427,248.71	6,914,374.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	812,094.47	303,708.42
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	388,049.56	721,176.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,896,129.46	15,412,581.56
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	3,129.76	12,953.45
<b>减：二、费用</b>		931,435.30	1,069,298.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	565,025.58	542,580.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	94,170.93	90,430.14



3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	192,947.35	395,354.28
5. 利息支出		-	710.40
其中：卖出回购金融资产支出		-	710.40
6. 税金及附加		22.08	19.88
7. 其他费用	6.4.7.20	79,269.36	40,202.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,669,918.99	22,405,508.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,669,918.99	22,405,508.24

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德主题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）	45,560,653.20	28,627,829.85	74,188,483.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,669,918.99	5,669,918.99
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）	-505,020.33	-360,497.91	-865,518.24
其中：1.基金申购款	1,186,532.22	812,052.03	1,998,584.25
2.基金赎回款	-1,691,552.55	-1,172,549.94	-2,864,102.49
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）	45,055,632.87	33,937,250.93	78,992,883.80
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)	19,345,233.31	12,292,906.27	31,638,139.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,405,508.24	22,405,508.24
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)	93,108,761.14	80,460,805.97	173,569,567.11
其中：1.基金申购款	105,806,497.29	89,274,159.17	195,080,656.46
2.基金赎回款	-12,697,736.15	-8,813,353.20	-21,511,089.35
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)	-	-61,020,972.33	-61,020,972.33
五、期末所有者权益(基金净值)	112,453,994.45	54,138,248.15	166,592,242.60

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

诺德主题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[2008]第 785 号《关于核准诺德主题灵活配置混合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《诺德主题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 238,700,715.81 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(2008)第 164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 11 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 238,722,490.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 21,774.19 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德主题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、法规或中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%；债券资产及其他金融工具占基金资产的 20%-70%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times$  沪深 300 指数 $+40\% \times$  上证国债指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德主题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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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	7,282,654.11
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：	7,282,654.11

### 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	51,938,498.77	62,191,561.25	10,253,062.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,901,579.94	92,900.25
	银行间市场	-	-
	合计	9,901,579.94	92,900.25
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	61,747,178.46	72,093,141.19	10,345,962.73

### 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

### 6.4.7.5 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	5,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,000.00	-

### 6.4.7.6 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。

### 6.4.7.7 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	648.34
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	87.10
应收债券利息	51,625.96
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	8.10
合计	52,369.50

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 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	47,442.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,442.20

**6.4.7.10 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	9.77
应付证券出借违约金	-
预提费用	69,424.36
合计	69,434.13

**6.4.7.11 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	45,560,653.20	45,560,653.20
本期申购	1,186,532.22	1,186,532.22
本期赎回(以“-”号填列)	-1,691,552.55	-1,691,552.55
- 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	45,055,632.87	45,055,632.87

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.12 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	35,535,717.98	-6,907,888.13	28,627,829.85
本期利润	2,773,789.53	2,896,129.46	5,669,918.99

本期基金份额交易产生的变动数	-394,496.93	33,999.02	-360,497.91
其中：基金申购款	927,537.08	-115,485.05	812,052.03
基金赎回款	-1,322,034.01	149,484.07	-1,172,549.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,915,010.58	-3,977,759.65	33,937,250.93

#### 6.4.7.13 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	8,914.20
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	2,753.10
其他	190.99
合计	11,858.29

#### 6.4.7.14 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	66,415,254.25
减：卖出股票成本总额	63,988,005.54
买卖股票差价收入	2,427,248.71

#### 6.4.7.15 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	8,902,554.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,001,028.62
减：应收利息总额	89,431.68
买卖债券差价收入	812,094.47



**6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.16 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.18 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	388,049.56
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	388,049.56

**6.4.7.19 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	2,896,129.46
——股票投资	2,704,797.69
——债券投资	191,331.77
——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	2,896,129.46

**6.4.7.20 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	3,043.18
基金转换费收入	86.58
合计	3,129.76

注：

1. 本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于 7 日（含）的投资者收取的赎回费，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付登记结算费和其他必要的手续费。
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，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。

**6.4.7.21 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	192,947.35
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	192,947.35

**6.4.7.22 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	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行间债券帐户维护费	9,000.00
银行费用	845.00
合计	79,269.36

### 6.4.7.23 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
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	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	565,025.58	542,580.76

其中：支付销售机构的客户维护费	23,822.78	26,098.95
-----------------	-----------	-----------

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 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	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	94,170.93	90,430.14

注：支付基金托管人中国建设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 × 0.25% / 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

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2008 年 11 月 5 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	4,989,005.50
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	-	4,989,005.50
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		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
中国建设银行	7,282,654.11	8,914.20	2,435,638.72	39,892.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
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	40	984.00	6,520.00	-

注：1、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。

2、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

本基金是一只偏股型的混合型基金，属于风险较高、收益较高风险品种。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为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。

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、稽核风控部组成。各自监督的内容和对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中国建设银行，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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 7.34%(2020 年 12 月 31 日：4.93%)。

### 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。



### 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上市公司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、存出保证金、债券投资等。

##### 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	7,282,654.11	-	-	-	-	-	7,282,654.11
结算备付金	193,628.10	-	-	-	-	-	193,628.10
存出保证金	17,966.42	-	-	-	-	-	17,966.42
交易性金融资产	115,249.70	101,470.00	9,684,860.24	-	-	62,191,561.25	72,093,141.19
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	462,154.67	462,154.67
应收利息	-	-	-	-	-	52,369.50	52,369.50
应收申购款	-	-	-	-	-	38,713.69	38,713.69
资产总计	12,609,498.33	101,470.00	9,684,860.24	-	-	62,744,799.11	85,140,627.68
负债							
应付证券清算	-	-	-	-	-	5,910,919.05	5,910,919.05

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,568.83	6,568.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	97,171.93	97,171.93
应付托管费	-	-	-	-	-	16,195.31	16,195.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	47,442.20	47,442.20
应交税费	-	-	-	-	-	12.43	12.43
其他负债	-	-	-	-	-	69,434.13	69,434.13
负债总计	-	-	-	-	-	6,147,743.88	6,147,743.88
利率敏感度缺口	12,609,498.33	101,470.00	9,684,860.24	-	-	-56,597,055.23	78,992,883.80
上年度末 2020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	2,741,402.10	-	-	-	-	-	2,741,402.10
结算备付金	320,637.86	-	-	-	-	-	320,637.86
存出保证金	45,513.81	-	-	-	-	-	45,513.81
交易性金融资产	3,799,620.00	2,631,453.39	1,029,746.24	-	-	-58,737,576.78	66,198,396.41
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,292,141.60	1,292,141.60
应收利息	-	-	-	-	-	92,082.70	92,082.70
应收申购款	-	-	-	-	-	52,315.96	52,315.96
资产总计	11,907,173.77	2,631,453.39	1,029,746.24	-	-	-60,174,117.04	75,742,490.44
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,283,974.26	1,283,974.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,272.88	12,272.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,202.19	119,202.19
应付托管费	-	-	-	-	-	19,867.03	19,867.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	58,624.88	58,624.88
应交税费	-	-	-	-	-	38.33	38.33
其他负债	-	-	-	-	-	60,027.82	60,027.82
负债总计	-	-	-	-	-	1,554,007.39	1,554,007.39
利率敏感度缺口	11,907,173.77	2,631,453.39	1,029,746.24	-	-	-58,620,109.65	74,188,483.05

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

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的 12.53%(2020 年 12 月 31 日：10.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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 30%-80%；债券资产及其他金融工具占基金资产的 20%-70%；基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	62,191,561.25	78.73	58,737,576.78	79.17
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	62,191,561.25	78.73	58,737,576.78	79.17

#### 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）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	3,371,811.25	2,694,896.65
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,371,811.25	-2,694,896.65

#### 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	62,191,561.25	73.05
	其中：股票	62,191,561.25	73.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,901,579.94	11.63
	其中：债券	9,901,579.94	11.63
	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	5,000,000.00	5.87
	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	7,476,282.21	8.78
8	其他各项资产	571,204.28	0.67
9	合计	85,140,627.68	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,044,186.99	78.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	4,720.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,386.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,251.03	0.04
J	金融业	1,872.00	0.00
K	房地产业	11,592.08	0.01
L	租赁和商务服务业	9,011.66	0.01
M	科学研究和技术服务业	7,240.59	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	57,866.99	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	728.80	0.00
R	文化、体育和娱乐业	6,028.13	0.01
S	综合	-	-
	合计	62,191,561.25	78.73

### 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	603369	今世缘	88,450	4,790,452.00	6.06
2	300327	中颖电子	45,947	3,916,062.81	4.96
3	002271	东方雨虹	64,800	3,584,736.00	4.54
4	002402	和而泰	147,100	3,525,987.00	4.46
5	000858	五粮液	11,800	3,515,102.00	4.45
6	000739	普洛药业	116,200	3,416,280.00	4.32
7	002851	麦格米特	103,725	3,239,331.75	4.10
8	000661	长春高新	7,200	2,786,400.00	3.53
9	000568	泸州老窖	11,200	2,642,528.00	3.35
10	600031	三一重工	83,700	2,433,159.00	3.08
11	600887	伊利股份	65,200	2,401,316.00	3.04
12	002511	中顺洁柔	85,056	2,343,292.80	2.97
13	600872	中炬高新	54,511	2,290,552.22	2.90
14	600519	贵州茅台	1,100	2,262,370.00	2.86
15	300363	博腾股份	25,400	2,136,648.00	2.70
16	000333	美的集团	29,501	2,105,486.37	2.67
17	002179	中航光电	26,473	2,091,896.46	2.65
18	600276	恒瑞医药	30,240	2,055,412.80	2.60
19	603501	XD 韦尔股	5,700	1,835,400.00	2.32
20	300737	科顺股份	56,200	1,766,928.00	2.24
21	600690	海尔智家	64,100	1,660,831.00	2.10
22	601799	星宇股份	6,200	1,399,464.00	1.77
23	300285	国瓷材料	26,600	1,296,750.00	1.64
24	600809	山西汾酒	2,000	896,000.00	1.13
25	000596	古井贡酒	2,740	656,230.00	0.83

26	300009	安科生物	28,476	424,292.40	0.54
27	603986	兆易创新	1,000	187,900.00	0.24
28	300912	凯龙高科	1,137	44,536.29	0.06
29	300853	申昊科技	641	24,614.40	0.03
30	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
31	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.03
32	605186	健麾信息	626	21,459.28	0.03
33	605080	浙江自然	337	21,163.60	0.03
34	300999	金龙鱼	228	19,370.88	0.02
35	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.02
36	300861	美畅股份	161	13,573.91	0.02
37	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
38	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.02
39	603171	税友股份	598	11,481.60	0.01
40	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
41	600741	华域汽车	400	10,508.00	0.01
42	605389	长龄液压	178	10,445.04	0.01
43	300871	回盛生物	258	10,062.00	0.01
44	600055	万东医疗	600	10,050.00	0.01
45	300406	九强生物	500	9,865.00	0.01
46	603836	海程邦达	413	9,011.66	0.01
47	300482	万孚生物	130	8,409.70	0.01
48	605298	必得科技	391	7,847.37	0.01
49	605155	西大门	350	7,696.50	0.01
50	605189	富春染织	306	7,371.54	0.01
51	300887	谱尼测试	81	7,240.59	0.01
52	003027	同兴环保	247	6,730.75	0.01
53	300919	中伟股份	40	6,520.00	0.01
54	300232	洲明科技	708	6,322.44	0.01
55	300876	蒙泰高新	175	5,783.75	0.01
56	300895	铜牛信息	170	5,781.70	0.01
57	300877	金春股份	154	5,662.58	0.01
58	300860	锋尚文化	97	5,653.16	0.01
59	300881	盛德鑫泰	182	5,603.78	0.01
60	300878	维康药业	115	5,367.05	0.01
61	600038	中直股份	100	5,274.00	0.01
62	605122	四方新材	196	5,233.20	0.01
63	300864	南大环境	95	5,225.95	0.01
64	300316	晶盛机电	100	5,050.00	0.01



65	000997	新大陆	300	4,977.00	0.01
66	601933	永辉超市	998	4,720.54	0.01
67	603538	美诺华	100	4,700.00	0.01
68	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
69	300893	松原股份	207	4,620.24	0.01
70	300910	瑞丰新材	44	4,600.20	0.01
71	300886	华业香料	134	4,345.62	0.01
72	300913	兆龙互连	164	4,296.80	0.01
73	300715	凯伦股份	180	4,242.60	0.01
74	300917	特发服务	147	4,066.02	0.01
75	600325	华发股份	600	4,044.00	0.01
76	300879	大叶股份	167	4,038.06	0.01
77	002138	顺络电子	100	3,877.00	0.00
78	300882	万胜智能	220	3,839.00	0.00
79	300911	亿田智能	54	3,741.12	0.00
80	300294	博雅生物	100	3,615.00	0.00
81	300898	熊猫乳品	99	3,589.74	0.00
82	300868	杰美特	108	3,305.88	0.00
83	603506	南都物业	182	2,608.06	0.00
84	300918	南山智尚	245	2,550.45	0.00
85	600258	首旅酒店	100	2,386.00	0.00
86	300271	华宇软件	97	1,867.25	0.00
87	600305	恒顺醋业	94	1,797.28	0.00
88	002036	联创电子	133	1,748.95	0.00
89	002373	千方科技	100	1,670.00	0.00
90	300738	奥飞数据	72	1,496.88	0.00
91	300383	光环新网	100	1,439.00	0.00
92	000967	盈峰环境	200	1,374.00	0.00
93	002126	银轮股份	100	1,040.00	0.00
94	603636	南威软件	100	963.00	0.00
95	002456	欧菲光	100	888.00	0.00
96	002044	美年健康	80	728.80	0.00
97	002695	煌上煌	44	696.52	0.00
98	002572	索菲亚	24	580.80	0.00
99	000656	金科股份	100	579.00	0.00
100	300451	创业慧康	65	574.60	0.00
101	601398	工商银行	100	517.00	0.00
102	601328	交通银行	100	490.00	0.00
103	601169	北京银行	100	487.00	0.00

104	600867	通化东宝	32	382.08	0.00
105	601818	光大银行	100	378.00	0.00
106	000681	视觉中国	29	374.97	0.00
107	600466	蓝光发展	100	295.00	0.00
108	300145	中金环境	64	194.56	0.00
109	600597	光明乳业	12	172.92	0.00
110	600764	中国海防	2	56.60	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	600887	伊利股份	6,412,394.69	8.64
2	300363	博腾股份	5,115,441.00	6.90
3	000739	普洛药业	4,591,145.00	6.19
4	000858	五粮液	4,246,903.00	5.72
5	603369	今世缘	3,732,376.00	5.03
6	600276	恒瑞医药	3,574,964.68	4.82
7	000661	长春高新	3,391,225.00	4.57
8	002991	甘源食品	2,437,684.00	3.29
9	002126	银轮股份	2,293,559.08	3.09
10	600519	贵州茅台	2,219,090.00	2.99
11	002402	和而泰	2,217,956.00	2.99
12	603538	美诺华	2,175,106.00	2.93
13	002271	东方雨虹	2,024,602.00	2.73
14	300737	科顺股份	1,962,542.00	2.65
15	002459	晶澳科技	1,836,000.00	2.47
16	600872	中炬高新	1,795,815.00	2.42
17	603501	韦尔股份	1,737,444.00	2.34
18	603596	伯特利	1,655,938.00	2.23
19	002851	麦格米特	1,583,336.00	2.13
20	600031	三一重工	1,418,156.00	1.91

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	300363	博腾股份	5,886,061.00	7.93
2	600887	伊利股份	3,620,266.00	4.88
3	000739	普洛药业	3,485,832.00	4.70
4	002695	煌上煌	3,244,808.00	4.37
5	603369	今世缘	2,792,865.00	3.76
6	603538	美诺华	2,671,162.50	3.60
7	300383	光环新网	2,421,364.00	3.26
8	603596	伯特利	2,420,362.49	3.26
9	002991	甘源食品	2,383,687.00	3.21
10	002126	银轮股份	2,023,960.02	2.73
11	300737	科顺股份	1,918,836.77	2.59
12	002439	启明星辰	1,742,030.59	2.35
13	002402	和而泰	1,720,795.00	2.32
14	002459	晶澳科技	1,693,083.57	2.28
15	002242	九阳股份	1,608,019.00	2.17
16	002036	联创电子	1,554,045.78	2.09
17	600276	恒瑞医药	1,522,400.42	2.05
18	002271	东方雨虹	1,451,927.00	1.96
19	001914	招商积余	1,433,369.60	1.93
20	002511	中顺洁柔	1,428,909.80	1.93

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	64,737,192.32
卖出股票收入（成交）总额	66,415,254.25

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	4,102,870.00	5.19
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,798,709.94	7.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,901,579.94	12.53

## 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	113042	上银转债	40,900	4,183,252.00	5.30
2	019649	21 国债 01	41,000	4,102,870.00	5.19
3	113604	多伦转债	11,810	1,243,002.50	1.57
4	127024	盈峰转债	1,174	129,151.74	0.16
5	110073	国投转债	1,070	115,249.70	0.15

## 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，上银转债的发行主体上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）存在被监管公开处罚的情形。

#### 1、上银转债

根据 2021 年 4 月 25 日的行政处罚决定，上海银行因未按照规定进行信息披露，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款 30 万元。

根据 2020 年 11 月 18 日的行政处罚决定，上海银行因 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则，以及 2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款共计 80 万元。

根据 2020 年 8 月 14 日的行政处罚决定，上海银行因 2014 年至 2019 年，存在下列违法违规行为：一、违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款，二、并购贷款管理严重违反审慎经营规则，三、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则，四、个人贷款业务严重违反审慎经营规则，五、流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则，六、违规向关系人发放信用贷款，七、发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款，八、贷款分类不准确，九、违规审批转让不符合不良贷款认定标准的信贷资产，十、虚增存贷款，十一、违规收费，十二、票据业务严重违反审慎经营规则，十三、同业资金投向管理严重违反审慎经营规则，十四、理财业务严重违反审慎经营规则，十五、委托贷款业务严重违反审慎经营规则，十六、内保外贷业务严重违反审慎经营规则，十七、衍生品交易人员管理严重违反审慎经营规则，十八、监事会履职严重不到位，十九、未经任职资格许可实际履行高级管理人员职责，二十、关联交易管理严重不审慎，二十一、押品估值管理严重违反审慎经营规则，二十二、未按规定保存重要信贷档案，导致分类信息不准确、不完整，二十三、未按规定报送统计报表，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元。

对上银转债的投资决策程序的说明：

本基金管理人认为，上述处罚事项未对上海银行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的情况,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	17,966.42
2	应收证券清算款	462,154.67
3	应收股利	-
4	应收利息	52,369.50
5	应收申购款	38,713.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	571,204.28

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113604	多伦转债	1,243,002.50	1.57
2	127024	盈峰转债	129,151.74	0.16
3	110073	国投转债	115,249.70	0.15
4	113601	塞力转债	101,470.00	0.13
5	113021	中信转债	10,557.00	0.01
6	110038	济川转债	10,497.00	0.01
7	128035	大族转债	5,530.00	0.01

### 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
1,559	28,900.34	37,433,865.73	83.08%	7,621,767.14	16.92%

### 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	287.48	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（ 2008 年 11 月 5 日 ）基金份额总额	238,722,490.00
本报告期期初基金份额总额	45,560,653.20
本报告期基金总申购份额	1,186,532.22
减：本报告期基金总赎回份额	1,691,552.55
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	45,055,632.87

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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 12 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	
天风证券	1	68,341,423.01	52.34%	63,646.72	55.43%	-
国盛证券	2	33,965,063.77	26.01%	24,838.75	21.63%	-
东吴证券	1	18,168,903.79	13.91%	16,920.93	14.74%	-
中金公司	1	7,540,280.00	5.77%	7,022.23	6.12%	-
西南证券	2	2,565,024.00	1.96%	2,388.85	2.08%	-
中天证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	2	-	-	-	-	-

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
天风证券	814,386.95	5.40%	-	-	-	-
国盛证券	12,078,879.10	80.02%	198,900,000.00	86.89%	-	-
东吴证券	2,201,655.42	14.59%	-	-	-	-
中金公司	-	-	25,000,000.00	10.92%	-	-
西南证券	-	-	5,000,000.00	2.18%	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

## 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	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司申购(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1月15日
2	诺德主题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
3	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
4	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富(北京)基金销售有限公司申(认)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1月30日
5	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
6	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司申购(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2月23日

7	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
8	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
9	诺德主题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
10	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
11	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西南证券股份有限公司申购（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 3 月 31 日
12	诺德主题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
13	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
14	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
15	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
16	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财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 17 日
17	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
18	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
19	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	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日

	资)、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告		
20	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申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 30 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	37,433,865.73	-	-	37,433,865.73	83.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

### 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、《诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德主题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、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告原文。

### 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