

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型
基金中基金（FOF）
2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 17 |
| §6 审计报告 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 18 |
| §7 年度财务报表 | 21 |
| 7.1 资产负债表..... | 21 |
| 7.2 利润表..... | 22 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |
| 7.4 报表附注..... | 25 |
| §8 投资组合报告 | 56 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 56 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 56 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 56 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 56 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 57 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 57 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 57 |

| | | |
|------------|--|-----------|
| 8.8 | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 57 |
| 8.9 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 57 |
| 8.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 | 57 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 57 |
| 8.12 | 本报告期投资基金情况 | 57 |
| 8.13 | 投资组合报告附注 | 60 |
| §9 | 基金份额持有人信息 | 62 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 62 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 62 |
| 9.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 62 |
| 9.4 | 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 | 62 |
| §10 | 开放式基金份额变动 | 63 |
| §11 | 重大事件揭示 | 64 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 64 |
| 11.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 64 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 64 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 64 |
| 11.5 | 本报告持有的基金发生的重大影响事件 | 64 |
| 11.6 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 64 |
| 11.7 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 64 |
| 11.8 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 64 |
| 11.9 | 其他重大事件 | 66 |
| §12 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 71 |
| 12.1 | 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 | 71 |
| 12.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 71 |
| §13 | 备查文件目录 | 72 |
| 13.1 | 备查文件目录 | 72 |
| 13.2 | 存放地点 | 72 |
| 13.3 | 查阅方式 | 72 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------|
| 基金名称 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF） |
| 基金简称 | 诺德大类精选（FOF） |
| 基金主代码 | 008079 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 9 日 |
| 基金管理人 | 诺德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商证券股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 304,958,560.72 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，通过积极主动的量化投资策略，进行全市场的资产配置和组合管理，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金将结合宏观配置策略的灵活性、主观观点的可融入性和量化投资策略纪律严格、风险水平可控的优势确定基金大类资产配置比例，并根据市场环境变化进行动态管理，再通过定量和定性相结合的方式优选标的基金构建投资组合，力争在严格控制整体风险的前提下，实现基金的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×75%+中国债券总指数收益率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。 |

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 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈培阳 | 韩鑫普 |
| | 联系电话 | 021-68985266 | 0755-82943666 |
| | 电子邮箱 | peiyang.chen@nuodefund.com | tgb@cmschina.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-0009 | 95565 |
| 传真 | | 021-68985121 | 0755-82960794 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 | 深圳市福田区福田街道福华一 |

| | | |
|-------|---------------------|---------|
| | 富城路 99 号震旦国际大楼 18 层 | 路 111 号 |
| 邮政编码 | 200120 | 518000 |
| 法定代表人 | 潘福祥 | 霍达 |

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 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 号震旦国际大楼 18 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年 | 2021 年 | 2020 年 |
|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -50,055,910.79 | 36,095,849.27 | 80,625,123.06 |
| 本期利润 | -104,351,892.58 | -1,903,141.57 | 133,375,813.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3055 | -0.0044 | 0.3366 |
| 本期加权平均净值利润率 | -25.64% | -0.32% | 28.37% |
| 本期基金份额净值增长率 | -20.89% | 0.70% | 35.31% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末 | 2021 年末 | 2020 年末 |
| 期末可供分配利润 | 30,477,659.20 | 117,649,306.76 | 87,323,094.18 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0999 | 0.3037 | 0.2117 |
| 期末基金资产净值 | 335,436,219.92 | 538,613,430.32 | 569,633,398.44 |
| 期末基金份额净值 | 1.0999 | 1.3903 | 1.3807 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022 年末 | 2021 年末 | 2020 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 9.99% | 39.03% | 38.07% |

注：

- 1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 2019 年 12 月 9 日。

3.2 基金净值表现

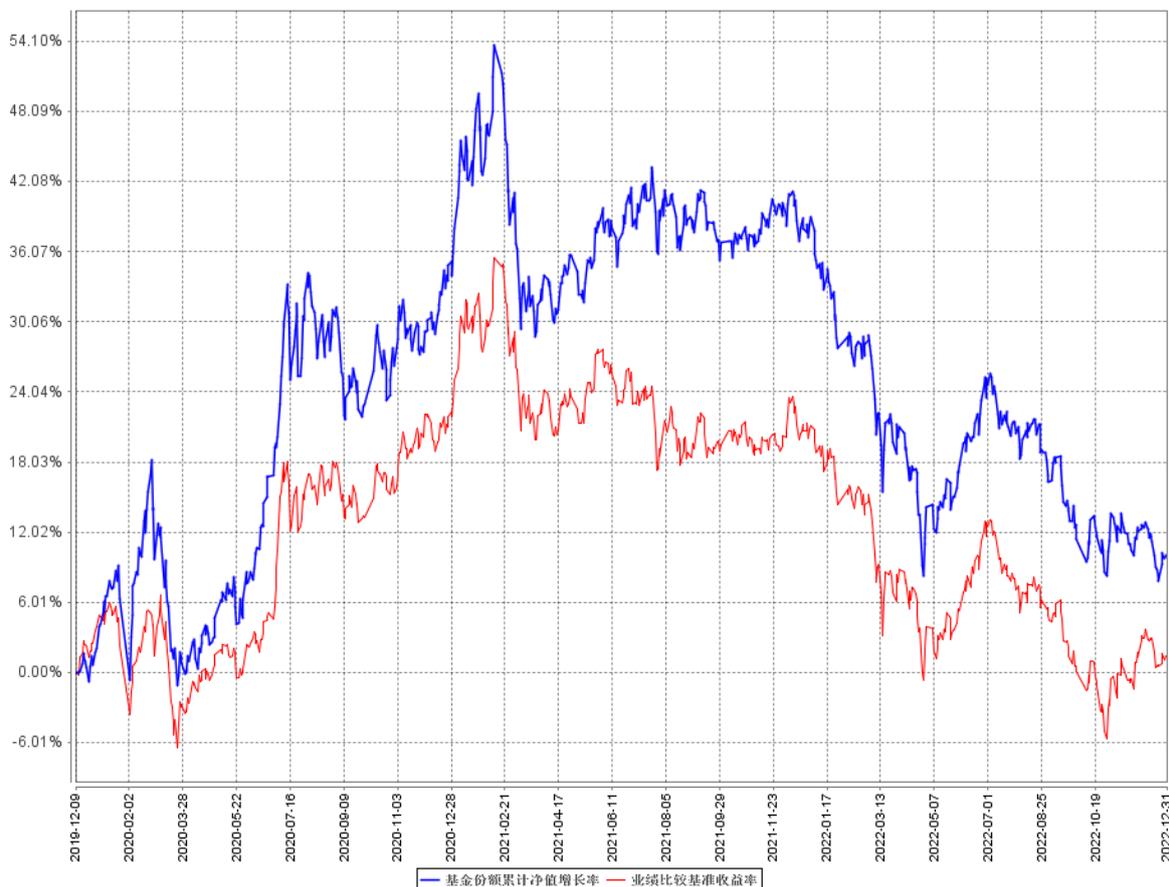
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.26% | 0.81% | 1.32% | 0.96% | -2.58% | -0.15% |
| 过去六个月 | -12.13% | 0.77% | -10.20% | 0.83% | -1.93% | -0.06% |
| 过去一年 | -20.89% | 0.96% | -16.35% | 0.96% | -4.54% | 0.00% |
| 过去三年 | 7.79% | 1.13% | -2.42% | 0.97% | 10.21% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.99% | 1.12% | 1.37% | 0.96% | 8.62% | 0.16% |

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*75%+中国债券总指数收益率*25%。

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

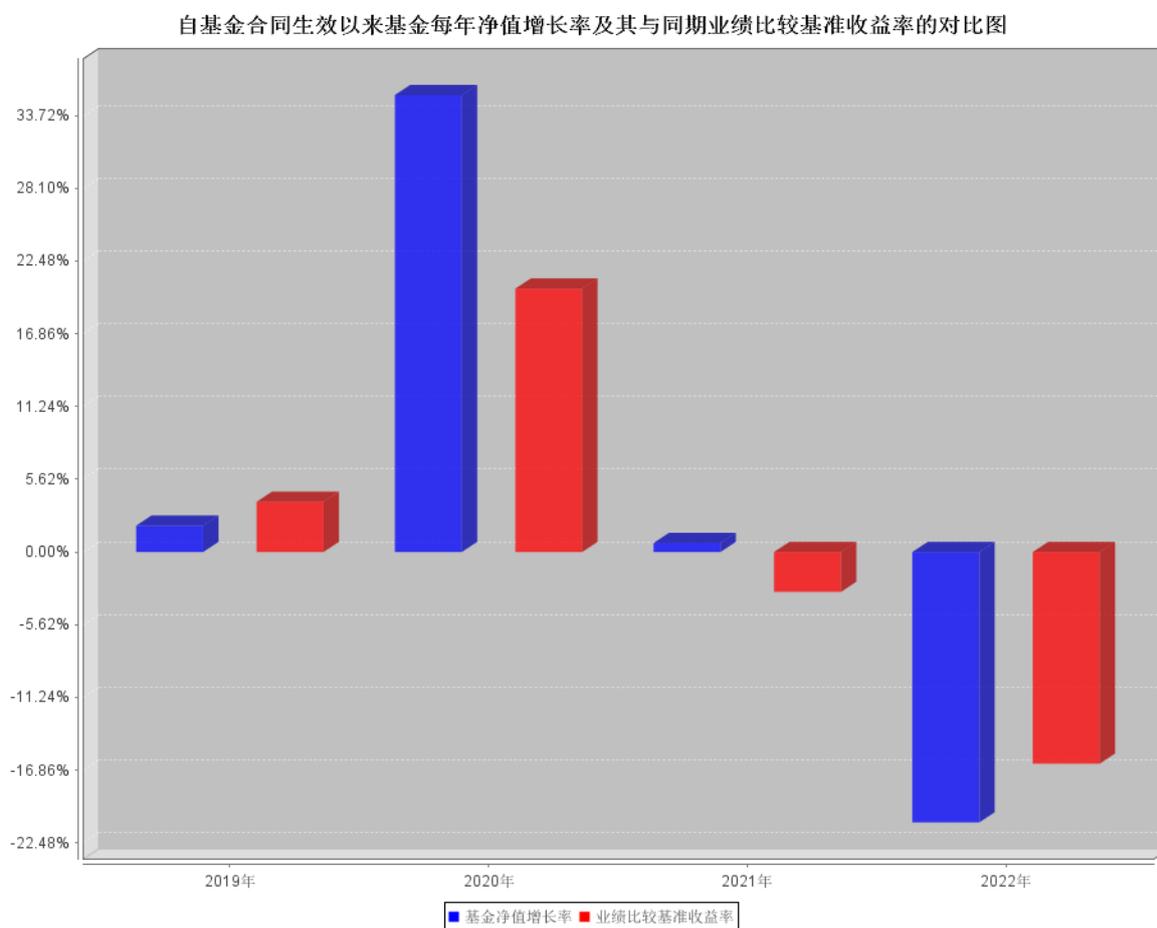
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2019 年 12 月 9 日，图示时间段为 2019 年 12 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日。

本基金建仓期间自 2019 年 12 月 9 日至 2020 年 6 月 8 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立于2019年12月9日，图示时间段为2019年12月9日至2022年12月31日基金净值增长率与业绩基准收益率比较，合同生效当年净值增长率按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2019年12月9日，自基金合同生效以来未发生利润分配事项。

§ 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。公司股东为天府清源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，公司管理了三十八只开放式基金：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、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金、诺德新能源汽车混合型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金、诺德策略回报股票型证券投资基金、诺德兴新趋势混合型证券投资基金、诺德中短债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郑源 | 本基金基金经理、FOF管理部投资总监、深圳 | 2019年12月9日 | - | 13 | 香港理工大学计算机博士。曾任中国银河证券股份有限公司高级研究员、民生证券股份有限公司资深研究员、 |

| | | | | |
|--|--------|--|--|--|
| | 分公司总经理 | | | 华泰联合证券有限责任公司资深研究员、中国创新投资有限公司（香港）投资经理、高扬集团有限公司（香港）投资经理。2017年1月加入诺德基金管理有限公司，现任FOF管理部投资总监、深圳分公司总经理。 |
|--|--------|--|--|--|

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为保证各类受托投资资金的安全，保证本公司各项资产管理业务的正常运行，维护投资者的合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定，基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》，确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合，严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，其规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体的控制措施包括：

一、实施信息隔离制度：公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理

之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；

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

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

四、公平执行交易指令：（1）交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关；（2）不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，对于需要分配交易量的交易，应当填写《公平交易审批表》，按比例分配的原则实施分配，保证不同投资组合获得公平的交易机会；（3）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室应按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易，应当实施公平性审核，填写《公平交易审批表》，报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本公司在 2022 年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经 T 检验分析和贡献率分析，本投资组合与其他投资组合日内、3 日内、5 日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况，也未发现其他存在利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不适用。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德

基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金与其它组合之间未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在过去的 2022 年中，中国内地权益市场整体震荡下行，但呈现出较为显著的风格分化和切换。经过 3 季度的调整，我们认为大类 FOF 的基金组合整体结构趋于合理。根据报告期内市场的整体表现，我们在组合中降低或清除了少量表现较差的基金标的的仓位，同时也在进行了充分细致的调研和风险评估后，调入了少量新的基金标的。

报告期内，在场内投资方面，我们大幅度降低了场内 ETF 的投资仓位。其主要原因是，我们判断当前市场已经处于较为明显的周期性底部，下行风险已经显著下降。此时利用场内 ETF 交易的灵活性来调整基金组合的仓位的效用显著下降，同时因市场上涨的可能性显著增强，仓位调整所带来的上行风险和踏空风险或将增大。因此，从 2022 年 4 季度开始，本基金的投资过程维持较高仓位，对于基金组合的风险控制主要通过调整组合的持仓结构来进行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0999 元，累计净值为 1.0999 元。本报告期份额净值增长率为-20.89%，同期业绩比较基准增长率为-16.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2023 年上半年，中国内地宏观经济的产能周期将有可能出现新周期的起点。预计在 2023 年 1 季度，宏观经济库存周期将可能从“主动去库存”向“被动去库存”进行切换，即宏观经济可能正处于中周期和短周期均由下而上的双重拐点阶段。从过去 20 年的 A 股市场运行规律来看，在这样的经济周期状态下，权益市场往往是受益的。再从整个 A 股市场的估值情况来看，我们相信未来一个季度权益市场的表现将会比较强势。从过往的历史数据来看，在“主动去库存”的最后阶段以及“被动去库存”的起始阶段，流动性仍会保持相对充裕状态并利好权益市场。我们判断至少在 2023 年 2 季度前，流动性仍会维持宽松状态。。根据宏观经济对权益市场的影响并结合过往的历史数据，当宏观经济处于短、中周期同时呈上行状态时，权益市场或将表现为大市值风格较强势的状态，或者至少表现为大小市值风格均衡的状态。

去年底，防疫政策已经基本全面取消。同时，中国内地经历了一轮高速的新冠病毒感染过程。我们可以看到经过春节大规模的人口流动之后，新冠病毒基本没有对内地再次产生大规模的冲击，基于此我们认为内地人群的新冠病毒“免疫屏障”已经基本形成，预计持续 3 年的新冠病毒对于经济运行的影响将会逐步消退，这将对“大消费”所涵盖各个行业，特别是具备社交和出行属性的消费行业形成重大利好。但考虑到从去年 11 月初防疫政策发生明显转向至今，这些行业均积累了较大幅度的涨幅并已较为充分地反映了复苏预期，因此我们预计市场或将进入到对这些行业实际恢复情况的观察阶段。那些业绩恢复符合预期并且持续改善的行业仍然具备向上的空间；反之，恢复不及预期的行业或将面临一定的下行压力。

从行业板块的景气特征和对基金经理的调研反馈来看，我们预计在 2023 年 1 季度中，光伏和风电产业链中下游可能表现良好。从政策层面来看，在经历了较为严重的国际地缘冲突所造成的传统能源短缺之后，全球各大主要经济体，包括美国、欧盟和中国等，对于提升新型能源占比的需求更为迫切。中国的上市企业在全球的新能源产业链中已经占据了重要的地位。在全球相关需求加速增长的背景下，相关企业的业绩极有可能呈现出持续高速增长状态。过去一年上游原材料价格持续压制光伏需求，但在 2022 年 4 季度其价格也出现了显著回调并将大力刺激相关电站的建设需求，进而或将对整个产业链中下游企业的利润率构成较大利好。因此我们认为该产业链的中下游企业以及配套设施板块都值得重点关注。

结合当前国家政策与基金经理的调研情况来看，我们认为 2023 年军工板块也值得重点关注。将来中国国防或将面临着更严峻的挑战，这对中国的军工行业提出了更严格、更紧迫的要求。考虑到未来军工行业的需求较为刚性，我们认为军工行业将会在较长时间内维持较高的景气度，在 2022 年 4 季度中，国家对于重要武器和重大装备的订单再次出现大规模的释放趋势，我们认为这对于相关厂商的订单和业绩或将有明显的提升效应。

另外，从过往的库存周期上行阶段的规律来看，中游行业可能会有获得超额收益的投资机会，主要包括建材、建筑、机械、化工和交运等行业。考虑到 PPI 下行的因素，这些行业的成本端价格同比已经大幅回落，而经济复苏所带来的终端价格上行压力或将有助于显著提升行业收入和利润水平。回顾过去一年，国家进行逆周期调节也惠及上述行业，我们认为这些行业的投资机会值得持续关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从保障基金份额持有人利益出发，继续加强了公司内部控制制度体系的建设，积极开展了风险管理及合规培训。公司内部设立专门的合规稽核部门，负责督促投资研究、市场营销、运营保障等业务部门合规运作，并实施定期和不定期检查，确保各项法规和

公司管理制度的有效落实，发现潜在违规风险及时与相关业务部门沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具稽核报告。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历。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

处的经济环境及相关重大事项进行判断；

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，招商证券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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2023)第 20673 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金 (FOF) 全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金 (FOF) (以下简称“诺德大类精选 (FOF) 基金”) 的财务报表, 包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表, 2022 年度的利润表和净资产 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了诺德大类精选 (FOF) 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于诺德大类精选 (FOF) 基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 强调事项 | 无 |
| 其他事项 | 无 |
| 其他信息 | 无 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>诺德大类精选 (FOF) 基金的基金管理人诺德基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估诺德大类精选</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>(FOF) 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算诺德大类精选 (FOF) 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺德大类精选 (FOF) 基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对诺德大类精选 (FOF) 基</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致诺德大类精选(FOF)基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 顾俊懿 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 审计报告日期 | 2023 年 3 月 28 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 19,012,956.70 | 33,507,647.13 |
| 结算备付金 | | 2,025,166.37 | 6,181,803.70 |
| 存出保证金 | | 694,378.15 | 914,846.80 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 327,910,072.87 | 501,949,077.69 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 327,910,072.87 | 501,949,077.69 |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 538,730.74 | 6,373,535.04 |
| 应收股利 | | 2,739.42 | - |
| 应收申购款 | | 0.03 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | 17,516.84 |
| 资产总计 | | 350,184,044.28 | 548,944,427.20 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 8,419,819.83 | 8,422,824.73 |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | | 5,390,684.02 | - |
| 应付管理人报酬 | | 296,585.59 | 458,297.91 |
| 应付托管费 | | 29,642.59 | 45,509.07 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 611,092.33 | 1,404,365.17 |
| 负债合计 | | 14,747,824.36 | 10,330,996.88 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 304,958,560.72 | 387,404,654.74 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | 30,477,659.20 | 151,208,775.58 |
| 净资产合计 | | 335,436,219.92 | 538,613,430.32 |
| 负债和净资产总计 | | 350,184,044.28 | 548,944,427.20 |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0999 元，基金份额总额 304,958,560.72 份。

7.2 利润表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|---|--|
| 一、营业总收入 | | -99,652,703.13 | 15,400,180.02 |
| 1. 利息收入 | | 512,087.79 | 697,249.74 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 512,087.79 | 697,249.74 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -45,868,858.99 | 52,672,698.08 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | 7.4.7.15 | -61,065,284.33 | 47,790,358.73 |
| 债券投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.20 | 15,196,425.34 | 4,882,339.35 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | -54,295,981.79 | -37,998,990.84 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.22 | 49.86 | 29,223.04 |
| 减：二、营业总支出 | | 4,699,189.45 | 17,303,321.59 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 4,087,673.83 | 5,987,806.34 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 408,503.00 | 597,012.47 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.23 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 4,608.59 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.25 | 203,012.62 | 10,713,894.19 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -104,351,892.58 | -1,903,141.57 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -104,351,892.58 | -1,903,141.57 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -104,351,892.58 | -1,903,141.57 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|-----------------|--|--------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 387,404,654.74 | - | 151,208,775.58 | 538,613,430.32 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 387,404,654.74 | - | 151,208,775.58 | 538,613,430.32 |

| | | | | |
|--|---|--------|-----------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -82,446,094.02 | - | -120,731,116.38 | -203,177,210.40 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -104,351,892.58 | -104,351,892.58 |
| （二）、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） | -82,446,094.02 | - | -16,379,223.80 | -98,825,317.82 |
| 其中：1.基金申购款 | 17,304,586.06 | - | 3,940,148.72 | 21,244,734.78 |
| 2.基金赎回款 | -99,750,680.08 | - | -20,319,372.52 | -120,070,052.60 |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 304,958,560.72 | - | 30,477,659.20 | 335,436,219.92 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 412,579,195.54 | - | 157,054,202.90 | 569,633,398.44 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 412,579,195.54 | - | 157,054,202.90 | 569,633,398.44 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -25,174,540.80 | - | -5,845,427.32 | -31,019,968.12 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,903,141.57 | -1,903,141.57 |
| （二）、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） | -25,174,540.80 | - | -3,942,285.75 | -29,116,826.55 |
| 其中：1.基金申购款 | 163,219,993.73 | - | 71,708,566.24 | 234,928,559.97 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 2.基金赎回款 | -188,394,534.53 | - | -75,650,851.99 | -264,045,386.52 |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 387,404,654.74 | - | 151,208,775.58 | 538,613,430.32 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| <u> 罗凯 </u> | <u> 罗凯 </u> | <u> 高奇 </u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)(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[2019]1478号《关于准予诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)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《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 332,986,013.47 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(2019)第 0670 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)基金合同》于 2019 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,097,325.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 111,311.65 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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)基金合同》和《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)招募说明书》的有关规定,本基金自基金合同生效后,每三个月开放一次申购和赎回。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金

中基金(FOF)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,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(但不包括 QDII 基金、香港互认基金)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、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、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具及法律、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)。本基金不得投资分级基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。本基金的投资组合比例为:本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%,其中股票型基金、混合型基金的投资比例合计占本基金资产的 60%-90%;本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期内,本基金持有的现金或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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 75%+中国债券总指数收益率 \times 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认

后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值

变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金 (LOF) 及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份 (百份) 收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间 (含节假日) 的万份 (百份) 收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间 (含节假日) 的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管

理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 33,507,647.13 元、6,181,803.70 元、914,846.80 元、17,516.84 元和 6,373,535.04 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 33,521,651.01 元、6,184,863.79 元、915,299.67 元、0.00 元和 6,373,535.04 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 501,949,077.69 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 501,949,077.69 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 8,422,824.73 元、458,297.91 元、45,509.07 元和 1,214,365.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 8,422,824.73 元、458,297.91 元、45,509.07 元和 1,214,365.17 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的

计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。

(2) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 19,012,956.70 | 33,507,647.13 |
| 等于：本金 | 18,999,500.90 | 33,507,647.13 |
| 加：应计利息 | 13,455.80 | - |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 定期存款 | - | - |
| 等于：本金 | - | - |
| 加：应计利息 | - | - |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 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 | - | - |
| 等于：本金 | - | - |
| 加：应计利息 | - | - |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 合计： | 19,012,956.70 | 33,507,647.13 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|-------------------|-------------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | 360,494,046.33 | - | 327,910,072.87 | -32,583,973.46 |
| 其他 | - | - | - | - |

| 合计 | 360,494,046.33 | - | 327,910,072.87 | -32,583,973.46 |
|---------------|---------------------|------|----------------|----------------|
| 项目 | 上年度末 2021年12月31日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | 480,237,069.36 | - | 501,949,077.69 | 21,712,008.33 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 480,237,069.36 | - | 501,949,077.69 | 21,712,008.33 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息 | - | 17,516.84 |
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | - | 17,516.84 |

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 431,092.33 | 1,214,365.17 |
| 其中：交易所市场 | 431,092.33 | 1,214,365.17 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 180,000.00 | 190,000.00 |
| 合计 | 611,092.33 | 1,404,365.17 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 387,404,654.74 | 387,404,654.74 |
| 本期申购 | 17,304,586.06 | 17,304,586.06 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -99,750,680.08 | -99,750,680.08 |
| - 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 | 304,958,560.72 | 304,958,560.72 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

不适用。

7.4.7.12 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 |
|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初 | 117,649,306.76 | 33,559,468.82 | 151,208,775.58 |
| 本期利润 | -50,055,910.79 | -54,295,981.79 | -104,351,892.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -19,037,369.94 | 2,658,146.14 | -16,379,223.80 |
| 其中：基金申购款 | 4,357,821.06 | -417,672.34 | 3,940,148.72 |
| 基金赎回款 | -23,395,191.00 | 3,075,818.48 | -20,319,372.52 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 48,556,026.03 | -18,078,366.83 | 30,477,659.20 |

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------|---|--|
| | 活期存款利息收入 | 425,285.03 |
| 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 | 70,257.36 | 87,044.62 |
| 其他 | 16,545.40 | 11,781.99 |
| 合计 | 512,087.79 | 697,249.74 |

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——买卖股票差价收入。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年12月31日 | 2021年1月1日至2021年12月31日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 5,687,300,643.70 | 9,499,719,773.69 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 5,743,176,229.48 | 9,451,929,414.96 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | - | - |
| 减：交易费用 | 5,189,698.55 | - |
| 基金投资收益 | -61,065,284.33 | 47,790,358.73 |

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益**7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 贵金属投资收益**7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.19 衍生工具收益**7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.19.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|--------------|
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 15,196,425.34 | 4,882,339.35 |
| 合计 | 15,196,425.34 | 4,882,339.35 |

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022 年12月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -54,295,981.79 | -37,998,990.84 |
| ——股票投资 | - | - |
| ——债券投资 | - | - |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | -54,295,981.79 | -37,998,990.84 |
| ——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 | -54,295,981.79 | -37,998,990.84 |

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12 月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 49.86 | 29,223.04 |
| 合计 | 49.86 | 29,223.04 |

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。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。

7.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.24 持有基金产生的费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期费用 | 上年度可比期间 |
|----|------|---------|
|----|------|---------|

| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 101,840.74 | 118,238.90 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 4,782,689.81 | 6,897,548.33 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 807,697.47 | 1,173,234.47 |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用 | 60,000.00 | 70,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行费用 | 23,012.62 | 42,951.28 |
| 交易费用 | - | 10,480,942.91 |
| 合计 | 203,012.62 | 10,713,894.19 |

7.4.7.26 分部报告

不适用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-------------------|
| 诺德基金管理有限公司（“诺德基金”） | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 招商证券股份有限公司（“招商证券”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 天府清源控股有限公司（“天府清源”） | 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期基金 成交总额的比 例 | 成交金额 | 占当期基金 成交总额的比 例 |
| 招商证券 | 1,373,911,435.93 | 13.25% | 688,391,008.77 | 4.21% |

7.4.10.1.5 权证交易

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权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | | | |
|-------|-----------------------------|----------------|----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |

| | | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|------------|------------------|
| 招商证券 | 355,916.33 | 11.90% | 0.00 | 0.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 招商证券 | 179,186.48 | 5.80% | 179,186.48 | 14.76% |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年12月31日 | 2021年1月1日至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,087,673.83 | 5,987,806.34 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,862,774.45 | 2,831,897.30 |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的1.00%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年12月31日 | 2021年1月1日至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 408,503.00 | 597,012.47 |

注：1. 本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.10% / 当年天数。

2. 本基金 2022 年度因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 264.49 元（2021 年度：0.00 元）。

7.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期末及上年度可比期间未持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 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持有转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金和股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金投资

的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。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制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金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、合规稽核部、风险控制部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券开立于招商银行股份有限公司的托管账户，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，违约风险可能性很小。

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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时间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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)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(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%(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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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 7.4.12。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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；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%。

于开放期内，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 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 | 19,012,956.70 | - | - | - | - | - | 19,012,956.70 |
| 结算备付金 | 2,025,166.37 | - | - | - | - | - | 2,025,166.37 |
| 存出保证金 | 694,378.15 | - | - | - | - | - | 694,378.15 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 327,910,072.87 | 327,910,072.87 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 538,730.74 | 538,730.74 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 2,739.42 | 2,739.42 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 0.03 | 0.03 |
| 资产总计 | 21,732,501.22 | - | - | - | - | 328,451,543.06 | 350,184,044.28 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 8,419,819.83 | 8,419,819.83 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 5,390,684.02 | 5,390,684.02 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 296,585.59 | 296,585.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 29,642.59 | 29,642.59 |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 611,092.33 | 611,092.33 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 14,747,824.36 | 14,747,824.36 |
| 利率敏感度缺口 | 21,732,501.22 | - | - | - | - | -313,703,718.70 | 335,436,219.92 |
| 上年度末 2021 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 | 33,507,647.13 | - | - | - | - | - | 33,507,647.13 |
| 结算备付金 | 6,181,803.70 | - | - | - | - | - | 6,181,803.70 |
| 存出保证金 | 914,846.80 | - | - | - | - | - | 914,846.80 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -501,949,077.69 | 501,949,077.69 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 6,373,535.04 | 6,373,535.04 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 17,516.84 | 17,516.84 |
| 资产总计 | 40,604,297.63 | - | - | - | - | -508,340,129.57 | 548,944,427.20 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 8,422,824.73 | 8,422,824.73 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 458,297.91 | 458,297.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 45,509.07 | 45,509.07 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,404,365.17 | 1,404,365.17 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 10,330,996.88 | 10,330,996.88 |
| 利率敏感度缺口 | 40,604,297.63 | - | - | - | - | -498,009,132.69 | 538,613,430.32 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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，以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中股票型基金、混合型基金的投资比例合计占本基金资产的 60%-90%；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内，本基金持有现金或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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2021 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 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | 327,910,072.87 | 97.76 | 501,949,077.69 | 93.19 |
| 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 | 327,910,072.87 | 97.76 | 501,949,077.69 | 93.19 |

7.4.13.4.3.2 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（2022 年 12 月 31 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 11,456,824.09 | 20,973,606.98 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -11,456,824.09 | -20,973,606.98 |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 327,910,072.87 | 501,949,077.69 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 327,910,072.87 | 501,949,077.69 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 327,910,072.87 | 93.64 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 21,038,123.07 | 6.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,235,848.34 | 0.35 |
| 9 | 合计 | 350,184,044.28 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%。本基金通过定量与定性相结合的方法对基金数据进行分析，获得符合本基金投资目标的备选基金池，再结合调研和公开数据收集等方式，筛选最终的投资标的。在此基础上，本基金通过相对分散的投资方式，构建基金组合。力求本基金资产的长期增值。本基金为 FOF 产品，其风险和预期收益低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金符合基金合同约定的投资范围、投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|---------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 519756 | 交银国企改革灵活配置混合 | 契约型开放式 | 7,671,834.85 | 14,423,049.52 | 4.30 | 否 |
| 2 | 166001 | 中欧新趋势混合（LOF）A | 契约型开放式 | 11,685,115.19 | 14,375,028.71 | 4.29 | 否 |
| 3 | 004674 | 富国新机遇灵活配置混合A | 契约型开放式 | 8,190,500.16 | 14,165,470.03 | 4.22 | 否 |
| 4 | 288002 | 华夏收入混合 | 契约型开放式 | 2,133,244.88 | 13,778,628.68 | 4.11 | 否 |
| 5 | 110012 | 易方达科汇灵活配置 | 契约型开放式 | 5,682,367.69 | 13,597,905.88 | 4.05 | 否 |
| 6 | 001667 | 南方转型混合A | 契约型开放式 | 6,737,050.88 | 13,143,986.27 | 3.92 | 否 |
| 7 | 163807 | 中银行业优选 | 契约型开放式 | 11,057,035.51 | 12,553,052.41 | 3.74 | 否 |
| 8 | 110001 | 易方达平稳增长 | 契约型开放式 | 2,429,600.00 | 11,890,462.40 | 3.54 | 否 |
| 9 | 000082 | 嘉实研究阿尔法股票 | 契约型开放式 | 6,619,171.86 | 11,484,263.18 | 3.42 | 否 |
| 10 | 519994 | 长信金利趋势 | 契约型开放式 | 26,441,871.32 | 11,409,667.47 | 3.40 | 否 |
| 11 | 005739 | 富国转型机遇 | 契约型开放式 | 5,601,100.00 | 11,180,915.82 | 3.33 | 否 |
| 12 | 007146 | 鹏华研究智选混合 | 契约型开放式 | 5,610,600.00 | 10,804,332.42 | 3.22 | 否 |
| 13 | 202001 | 南方稳健成长混合 | 契约型开放式 | 5,349,967.18 | 10,732,034.16 | 3.20 | 否 |
| 14 | 550008 | 信诚优胜精选混合 | 契约型开放式 | 5,636,558.83 | 10,706,079.84 | 3.19 | 否 |
| 15 | 008187 | 淳厚信睿混合C | 契约型开放式 | 6,083,900.00 | 10,571,384.64 | 3.15 | 否 |
| 16 | 450009 | 国富中小盘 | 契约型开放式 | 4,034,548.68 | 10,429,308.34 | 3.11 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------|--------|--------------|--------------|------|---|
| 17 | 519133 | 海富通改革驱动 | 契约型开放式 | 4,440,500.00 | 9,806,400.20 | 2.92 | 否 |
| 18 | 001743 | 诺安优选回报混合 | 契约型开放式 | 5,638,749.03 | 9,619,705.85 | 2.87 | 否 |
| 19 | 450001 | 国富中国收益 | 契约型开放式 | 6,127,187.76 | 8,041,933.94 | 2.40 | 否 |
| 20 | 001490 | 汇添富国企创新增长 | 契约型开放式 | 4,157,807.55 | 7,941,412.42 | 2.37 | 否 |
| 21 | 009402 | 交银启明混合A | 契约型开放式 | 4,750,755.09 | 6,788,829.02 | 2.02 | 否 |
| 22 | 007777 | 中邮研究精选混合 | 契约型开放式 | 6,157,758.10 | 6,787,696.75 | 2.02 | 否 |
| 23 | 004673 | 华夏短债C | 契约型开放式 | 6,361,615.49 | 6,520,019.72 | 1.94 | 否 |
| 24 | 001736 | 圆信永丰优加生活 | 契约型开放式 | 2,155,500.00 | 6,360,018.30 | 1.90 | 否 |
| 25 | 001043 | 工银美丽城镇股票A | 契约型开放式 | 3,107,800.00 | 6,218,707.80 | 1.85 | 否 |
| 26 | 519002 | 华安安信消费混合A | 契约型开放式 | 1,402,329.19 | 6,095,924.99 | 1.82 | 否 |
| 27 | 511990 | 华宝添益 | 契约型开放式 | 60,003.00 | 6,001,140.04 | 1.79 | 否 |
| 28 | 100028 | 富国天时货币B | 契约型开放式 | 6,000,294.27 | 6,000,294.27 | 1.79 | 否 |
| 29 | 161623 | 融通汇财宝货币B | 契约型开放式 | 6,000,000.00 | 6,000,000.00 | 1.79 | 否 |
| 30 | 160813 | 长盛同盛成长优选(LOF) | 契约型开放式 | 3,722,936.00 | 5,152,543.42 | 1.54 | 否 |
| 31 | 000925 | 汇添富外延增长股票A | 契约型开放式 | 3,627,700.00 | 5,136,823.20 | 1.53 | 否 |
| 32 | 003875 | 浙商日添金货币B | 契约型开放式 | 5,011,027.98 | 5,011,027.98 | 1.49 | 否 |
| 33 | 011128 | 华安精致生活混合A | 契约型开放式 | 4,103,383.30 | 4,964,273.12 | 1.48 | 否 |
| 34 | 003501 | 泰达睿智稳健混合A | 契约型开放式 | 4,497,738.64 | 4,840,916.10 | 1.44 | 否 |
| 35 | 004959 | 圆信永丰悦生活混合 | 契约型开放式 | 2,664,928.71 | 4,687,609.60 | 1.40 | 否 |
| 36 | 512200 | 南方中证 | 契约型开 | 2,400,000.00 | 1,728,000.00 | 0.52 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|-------------------------------|------------|--------------|--------------|------|---|
| | | 全指房地 产ETF | 放式 | | | | |
| 37 | 512800 | 华宝中证 银行ETF | 契约型开 放式 | 1,600,000.00 | 1,724,800.00 | 0.51 | 否 |
| 38 | 519702 | 交银趋势 混合A | 契约型开 放式 | 345,005.68 | 1,480,626.38 | 0.44 | 否 |
| 39 | 515170 | 华夏中证 细分食品 饮料产业 主题ETF | 契约型开 放式 | 1,600,000.00 | 1,209,600.00 | 0.36 | 否 |
| 40 | 510050 | 华夏上证 50ETF | 契约型开 放式 | 300,000.00 | 794,700.00 | 0.24 | 否 |
| 41 | 159766 | 富国中证 旅游主题 ETF | 契约型开 放式 | 700,000.00 | 790,300.00 | 0.24 | 否 |
| 42 | 159949 | 华安创业 板50ETF | 契约型开 放式 | 700,000.00 | 720,300.00 | 0.21 | 否 |
| 43 | 515790 | 华泰柏瑞 中证光伏 产业ETF | 契约型开 放式 | 500,000.00 | 687,000.00 | 0.20 | 否 |
| 44 | 516780 | 华泰柏瑞 中证稀土 产业ETF | 契约型开 放式 | 400,000.00 | 420,400.00 | 0.13 | 否 |
| 45 | 515120 | 广发中证 创新药产 业ETF | 契约型开 放式 | 600,000.00 | 417,000.00 | 0.12 | 否 |
| 46 | 159998 | 天弘中证 计算机主 题ETF | 契约型开 放式 | 500,000.00 | 400,500.00 | 0.12 | 否 |
| 47 | 159828 | 国泰中证 医疗ETF | 契约型开 放式 | 500,000.00 | 316,000.00 | 0.09 | 否 |

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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 | 694,378.15 |
| 2 | 应收清算款 | 538,730.74 |
| 3 | 应收股利 | 2,739.42 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 0.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,235,848.34 |

8.13.4 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。

8.13.5 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情况。

8.13.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 10,181 | 29,953.69 | 12,287,297.79 | 4.03% | 292,671,262.93 | 95.97% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 7.80 | 0.0000% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019年12月9日）基金份额总额 | 333,097,325.12 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 387,404,654.74 |
| 本报告期基金总申购份额 | 17,304,586.06 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 99,750,680.08 |
| 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 | 304,958,560.72 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- (2) 本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。
本报告期内无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件

无。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2022 年度的基金审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的报酬人民币 6 万元，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 4 年的审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理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及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情形。

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
| | | | | |

| | 数量 | 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 | |
|------------|----|------|----------------------|------------|----------------|---|
| 招商证券 | 2 | - | - | 355,916.33 | 11.90% | - |
| 中信建投证 券 | 2 | - | - | 782,520.14 | 26.16% | - |
| 财信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海 | 2 | - | - | 100,973.65 | 3.38% | - |
| 平安证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | 354,996.54 | 11.87% | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | 663,590.72 | 22.18% | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 2 | - | - | 733,505.05 | 24.52% | - |

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：江海证券有限公司。

11.8.2 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 | | 基金交易 | |
|------|------|-----|--------|-------|------|------|------|------|
| | 成交金 | 占当期 | 成交金额 | 占当期债券 | 成交金额 | 占当期权 | 成交金额 | 占当期基 |

| | 额 | 债券 成交总 额的比例 | | 回购 成交总额的 比例 | | 证 成交总额 的比例 | | 金 成交总额 的比例 |
|------------|---|-------------------|---|-------------------|---|------------------|------------------|------------------|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | 1,373,911,435.93 | 13.25% |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - | - | 3,013,567,093.12 | 29.06% |
| 财信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东亚前海 | - | - | - | - | - | - | 631,078,334.52 | 6.09% |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | 984,923,762.14 | 9.50% |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | 2,324,257,468.46 | 22.41% |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - | 2,042,680,416.28 | 19.70% |

11.9 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公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 1 月 5 日 |
| 2 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平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 | 2022 年 1 月 20 日 |
| 3 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2021 年第 4 季度报告 | 指定互联网网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 4 | 诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 1 月 24 日 |

| | | | |
|----|---|------------------|-----------------|
| | 公告 | | |
| 5 | 诺德基金管理有限公司关于诺德 大类精选配置三个月定期开放混 合型基金中基金（FOF）开放日常 申购、赎回业务的公告 | 证券日报、指定互联 网网站 | 2022 年 1 月 26 日 |
| 6 | 诺德基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加第一创业证券股份 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 | 2022 年 2 月 10 日 |
| 7 | 诺德基金管理有限公司关于旗下 部分基金在上海华夏财富投资管 理有限公司开通申购（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 | 2022 年 2 月 25 日 |
| 8 | 诺德基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加国金证券股份有限 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 | 2022 年 3 月 11 日 |
| 9 | 诺德基金管理有限公司关于旗下 部分基金在上海中欧财富基金销 售有限公司开通申（认）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 | 2022 年 3 月 18 日 |
| 10 | 诺德基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加上海利得基金销售 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 | 2022 年 3 月 30 日 |
| 11 | 诺德大类精选配置三个月定期开 放混合型基金中基金（FOF）2021 | 指定互联网网站 | 2022 年 3 月 30 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| | 年年度报告 | | |
| 12 | 诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 3 月 30 日 |
| 13 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东肯特瑞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 | 2022 年 4 月 9 日 |
| 14 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2022 年第 1 季度报告 | 指定互联网网站 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 15 | 诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 16 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海好买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 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 17 | 诺德基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 18 | 诺德基金管理有限公司关于诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回业务的公告 | 证券日报、指定互联网网站 | 2022 年 5 月 21 日 |
| 19 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2022 年第 2 季度报告 | 指定互联网网站 | 2022 年 7 月 21 日 |
| 20 | 诺德基金管理有限公司旗下部分 | 四大报、指定互联网 | 2022 年 7 月 21 日 |

| | | | |
|----|--|-------------------------|------------------|
| | 基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告 | 网站 | |
| 21 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券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 | 2022 年 8 月 10 日 |
| 22 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中泰证券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 | 上海证券报、证券日报、证券时报、指定互联网网站 | 2022 年 8 月 18 日 |
| 23 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2022 年中期报告 | 指定互联网网站 | 2022 年 8 月 31 日 |
| 24 | 诺德基金管理有限公司关于诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回业务的公告 | 指定互联网网站 | 2022 年 9 月 10 日 |
| 25 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告 | 四大报、指定互联网网站 | 2022 年 9 月 30 日 |
| 26 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要（更新）20220930 | 指定互联网网站 | 2022 年 9 月 30 日 |
| 27 | 诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2022 年 9 月） | 指定互联网网站 | 2022 年 9 月 30 日 |
| 28 | 诺德大类精选配置三个月定期开 | 指定互联网网站 | 2022 年 10 月 26 日 |

| | | | |
|----|--|------------------|------------------|
| | 放混合型基金中基金（FOF）2022 年第 3 季度报告 | | |
| 29 | 诺德基金管理有限公司旗下部分 基金 2022 年第 3 季度报告提示性 公告 | 四大报、指定互联网 网站 | 2022 年 10 月 26 日 |
| 30 | 诺德基金管理有限公司关于诺德 大类精选配置三个月定期开放混 合型基金中基金（FOF）开放日常 申购、赎回业务的公告 | 证券日报、指定互联 网网站 | 2022 年 12 月 19 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）基金合同》。
- 3、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）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、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2022 年年度报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住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

2023 年 3 月 31 日