诺德成长优势混合型证券投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

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

基金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 2024 年 3 月 27 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 2023 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 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 审计报告 15

6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 22

§8 投资组合报告 51

8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
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 53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 60
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 60
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 60
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 60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
8.12 投资组合报告附注 60

§9 基金份额持有人信息 61

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
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情况 61
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 61

§10 开放式基金份额变动 61

§11 重大事件揭示 62

11.1 基金份额持有人大会决议 62
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 62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
11.4 基金投资策略的改变 62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 62
11.8 其他重大事件 67

§12 影响投资者决策的其他重要信息 69

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 69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 70

§13 备查文件目录 70

13.1 备查文件目录 70
13.2 存放地点 70
13.3 查阅方式 70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德成长优势混合型证券投资基金
基金简称	诺德成长优势混合
基金主代码	570005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 22 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	431,572,459.28 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注具备高成长潜力的行业和个股，通过投资于具备充分成长空间的行业和拥有持续竞争优势的企业，分享中国经济和资本市场高速发展的成果。基于对世界和中国经济增长和产业结构变迁、全球技术创新和商业模式演化、上市公司争夺和把握成长机遇能力等因素的深入分析，在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人创造风险收益比合理、超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金本着成长投资的理念，在构建投资组合时着重寻找成长性行业中的优势企业。本基金设计了“成长行业投资吸引力”模型，从“成长特性”和“安全边际”两个角度评估行业投资价值，通过定性和定量的指标体系以及管理层访谈、实地调研等方式对公司进入深入研究，评估企业的投资价值。本着“成长行业”和“优势企业”的两个选股维度,对最具吸引力的行业和个股进行更加深入的研究，找到最终投资标的，进行超额配置，完成投资组合的构建。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%＋上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈培阳	王小飞
	联系电话	021-68985266	021-60637103
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0009	021-60637228
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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-172,924,079.13	-30,244,721.10	271,075.01
本期利润	-189,708,271.83	-36,826,683.99	-34,949,584.41
加权平均基金份额本期利润	-0.2849	-0.1543	-0.1183
本期加权平均净值利润率	-22.77%	-6.65%	-4.20%
本期基金份额净值增长率	-19.55%	-13.90%	-4.61%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	4,606,697.23	361,173,291.35	308,672,923.81
期末可供分配基金份额利润	0.0107	0.5373	1.7077
期末基金资产净值	436,179,156.51	1,033,385,156.94	489,427,215.12
期末基金	1.011	1.537	2.708

份额净值			
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	196.53%	268.59%	328.08%

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 2009 年 9 月 22 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

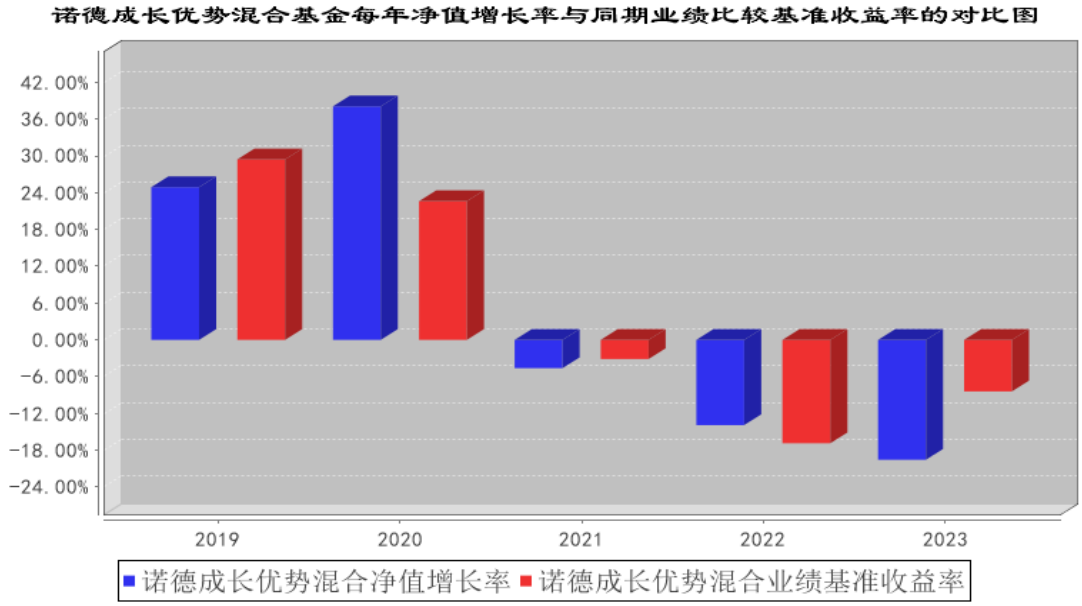
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.51%	0.46%	-5.47%	0.63%	2.96%	-0.17%
过去六个月	-11.39%	0.58%	-8.30%	0.68%	-3.09%	-0.10%
过去一年	-19.55%	0.61%	-8.40%	0.68%	-11.15%	-0.07%
过去三年	-33.93%	0.86%	-26.23%	0.89%	-7.70%	-0.03%
过去五年	13.96%	0.87%	17.08%	0.97%	-3.12%	-0.10%
自基金合同生效起至今	196.53%	1.20%	23.89%	1.12%	172.64%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数*80%+上证国债指数*20%。

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

注：本基金成立于 2009 年 9 月 22 日，图示时间段为 2009 年 9 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日。本基金建仓期为 2009 年 9 月 22 日至 2010 年 3 月 21 日，报告期结束资产配置比符合本基金基金合同规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：12

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分	现金形式发放总额	再投资形式发放总	年度利润分配合计	备注

	红数		额		
2023 年	2.6100	166,651,028.15	41,155,655.07	207,806,683.22	-
2022 年	7.9000	443,935,357.00	57,064,096.34	500,999,453.34	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	10.5100	610,586,385.15	98,219,751.41	708,806,136.56	-

§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北京天朗云创信息技术有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了四十只开放式基金：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、诺德惠享稳健三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、诺德安承利率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		

郝旭东	本基金基金经理、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金和诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德策略回报股票型证券投资基金的基金经理、总经理助理	2015 年 7 月 11 日	-	15 年	上海交通大学博士。2011 年 1 月起加入诺德基金管理有限公司,在投资研究部从事投资管理相关工作,担任行业研究员,曾任职于西部证券股份有限公司，担任高级研究员，具有基金从业资格。
郭纪亭	本基金基金经理、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金和诺德策略精选混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 9 月 25 日	-	9 年	北京大学金融学硕士，2014 年开始从事资产管理行业工作。2016 年 6 月加入诺德基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理职务，具有基金从业资格。

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

公司用职级管理相关规定作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作表现，设立不同职务等级。基金经理作为公司运营的核心，设立单独职级序列。基金经理薪酬严格按照职级管理相关规定进行管理。同时，公司根据有关法规要求，建立薪酬递延机制。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本公司在 2023 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

基金经理严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易相关制度要求执行，对公平交易进行管理，独立确定投资组合的交易价格和数量。报告期内，不存在违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，市场除红利指数外，整体处于回落状态。其中，沪深 300 下跌 11.38%、创业板指下跌 19.41%、中证 500 下跌 7.42%、中证红利指数上涨 0.89%。行业层面，跌多涨少，按申万一级行业划分，涨跌幅排名居于前三的通信、传媒、计算机分别上涨 25.75%、16.80%、8.97%，而后三名的美容护理、商贸零售、房地产则分别下跌 32.03%、31.30%、26.39%。总体来看，2023 年市

场整体偏弱，除上半年人工智能主题带动科技股有所表现外，其他期间内的主要宽基及行业指数整体表现相对不佳，同时，在弱势市场下，红利等防守性板块具备一定的超额收益。

市场风格方面，小微盘指数表现相对优异，反映市场最小市值的 3 个指数从高到低依次是中证 2000、万得微盘和北证 50，全年分别上涨 5.57%、49.88%和 14.92%，均显著优于大盘指数。而从上市公司财报中可以看到，三季度单季度，沪深 300、中证 1000、创业板指（剔除温氏）、北证 50 单季度净利润同比增速分别为-1%、-11.3%、+9.6%和-23.9%，基本是越小市值公司业绩增长表现越差。因此，市场风格和基本面的背离，可以理解为在优质公司消化估值而缺少投资机会的过程中，前期系统性极度低估的小市值股票整体的估值回归过程。

报告期内，本基金仍保持均衡配置、精选个股的总体策略，基金仓位较为灵活，择机进行了仓位调整。在配置上，本基金仍以经营相对稳定、业绩确定性较高的个股作为底仓，增配红利、医药、周期等部分行业个股，同时注重估值水平和个股流动性因素。

拉长周期看，A 股的获利来源主要是上市公司盈利，也即经济增长的钱，2021 年以来主要指数回落的主要原因是 2017 年以来赛道化景气投资导致的远期估值透支下的回归。经历近 3 年的调整震荡，很多龙头权重估值已经调整到与较低业绩增长（即较低经济增速）或海外对标估值相匹配的水平，主要指数股债收益差处于-2 倍标准差附近，市场整体估值处于合理偏低水平。同时，伴随 2023 年主题投资的盛行，前期低估的小市值股票估值得到较大修复，相对优质龙头股票吸引力下降，2024 年有望在市场出现企稳反弹的同时，风格亦转向优质上市公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.011 元，累计净值为 2.982 元。本报告期份额净值增长率为-19.55%，同期业绩比较基准增长率为-8.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来本基金将主要关注以下几方面的投资机会，一是伴随经济进入稳定增长阶段，前期盈利和估值受到压制的部分顺周期板块，此类标的或将获得业绩增长及估值修复的双重收益可能；二是前期跌幅较大，估值回落到合理偏低，而行业景气有望在 2024 年迎来反转的部分赛道类股票，如消费医疗、高端制造等。

在投资策略上，本基金仍力求以合理的价格买入，力争获取确定性收益，力求在全行业全市场选股，不拘泥于某一个或几个特定行业，从而达到分散风险的目标。在选股策略上，本基金始终坚持业绩增长与股价匹配原则精选个股，秉持绝对收益投资理念，坚持以合理的价格买入，力争获取确定性收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从保障基金份额持有人利益出发，继续加强了公司内部控制制度体系的建设，积极开展了风险管理及合规培训。公司内部设立专门的合规稽核部门，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

本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会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确保估值政策和程序的一贯性。估值委员会由投资、研究、风控、合规、清算等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的业务负责人员或相关指定人员担任。估值委员会成员中不包含基金经理，基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。上述各方不存在任何重大利益冲突。

基金日常估值由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2023 年 05 月 29 日实施利润分配，每份基金份额派发红利 0.261 元。

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，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，本基金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损害基金份额持有人利益的行为 。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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(2024)第 20470 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	诺德成长优势混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了诺德成长优势混合型证券投资基金(以下简称“诺德成长优势混合基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

	(二)我们的意见 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，公允反映了诺德成长优势混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于诺德成长优势混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	诺德成长优势混合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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估诺德成长优势混合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成长优势混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督诺德成长优势混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对诺德成长优势混合基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成长优势混合基金不能持续经营。 (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。 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。
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	魏佳亮　　顾俊懿
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺德成长优势混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	112,248,535.60	196,563,972.95
结算备付金		1,636,444.16	9,604,506.41
存出保证金		590,454.09	502,923.70
交易性金融资产	7.4.7.2	343,371,748.57	827,493,707.16
其中：股票投资		343,371,748.57	807,578,215.45
基金投资		-	-
债券投资		-	19,915,491.71
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	-	134,494,000.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		69,082.37	75,120.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		457,916,264.79	1,168,734,230.32
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 2022 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		19,510,347.44	130,058,828.53
应付赎回款		190,015.71	121,570.70
应付管理人报酬		462,666.78	1,645,274.02
应付托管费		77,111.13	274,212.36
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	1,496,967.22	3,249,187.77
负债合计		21,737,108.28	135,349,073.38
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	431,572,459.28	672,211,865.59
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	4,606,697.23	361,173,291.35
净资产合计		436,179,156.51	1,033,385,156.94
负债和净资产总计		457,916,264.79	1,168,734,230.32

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.011 元，基金份额总额 431,572,459.28 份。

7.2 利润表

会计主体：诺德成长优势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-175,528,288.10	-27,087,578.62
1.利息收入		1,000,495.09	705,270.88
其中：存款利息收入	7.4.7.13	986,806.18	664,600.36
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		13,688.91	40,670.52
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-160,377,295.67	-21,271,341.44
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-165,706,515.53	-24,846,255.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-44,372.70	91,694.73
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	5,373,592.56	3,483,219.56
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）	7.4.7.20	-16,784,192.70	-6,581,962.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	632,705.18	60,454.83
减：二、营业总支出		14,179,983.73	9,739,105.37
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	11,967,157.17	8,161,050.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	1,994,526.15	1,360,175.01
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	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	0.32
8．其他费用	7.4.7.23	218,300.41	217,880.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-189,708,271.83	-36,826,683.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-189,708,271.83	-36,826,683.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-189,708,271.83	-36,826,683.99

7.3 净资产变动表

会计主体：诺德成长优势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	672,211,865.59	-	361,173,291.35	1,033,385,156.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	672,211,865.59	-	361,173,291.35	1,033,385,156.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-240,639,406.31	-	-356,566,594.12	-597,206,000.43
（一）、综合收益总额	-	-	-189,708,271.83	-189,708,271.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-240,639,406.31	-	40,948,360.93	-199,691,045.38

其中：1.基金申购款	289,942,907.66	-	111,396,855.34	401,339,763.00
2.基金赎回款	-530,582,313.97	-	-70,448,494.41	-601,030,808.38
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-207,806,683.22	-207,806,683.22
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	431,572,459.28	-	4,606,697.23	436,179,156.51
项目	上年度可比期间 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	180,754,291.31	-	308,672,923.81	489,427,215.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	180,754,291.31	-	308,672,923.81	489,427,215.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	491,457,574.28	-	52,500,367.54	543,957,941.82
（一）、综合收益总额	-	-	-36,826,683.99	-36,826,683.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	491,457,574.28	-	590,326,504.87	1,081,784,079.15
其中：1.基金申购款	528,145,197.46	-	645,057,741.56	1,173,202,939.02
2.基金赎回款	-36,687,623.18	-	-54,731,236.69	-91,418,859.87

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-500,999,453.34	-500,999,453.34
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	672,211,865.59	-	361,173,291.35	1,033,385,156.94

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德成长优势混合型证券投资基金(原名为诺德成长优势股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]471 号《关于核准诺德成长优势股票型证券投资基金募集的批复》核准，由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德成长优势股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 514,582,006.70 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(2009)第 166 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德成长优势股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 514,662,125.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 80,118.84 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，诺德成长优势股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为诺德成长优势混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德成长优势混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；债券及其他货币市场工具占基金资产的 0-35%；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：80%×沪深 300 指数＋20%×上证国债指数。

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 2024 年 3 月 25 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》、《诺德成长优势混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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、金融负债或权益工具。

(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、买入返售金融资产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债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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逐日确认。

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股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流

通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

活期存款	112,248,535.60	196,563,972.95
等于：本金	112,233,002.62	196,534,438.70
加：应计利息	15,532.98	29,534.25
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	112,248,535.60	196,563,972.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		338,891,779.95	-	343,371,748.57	4,479,968.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		338,891,779.95	-	343,371,748.57	4,479,968.62
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		786,301,334.13	-	807,578,215.45	21,276,881.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	19,840,720.00	87,491.71	19,915,491.71	-12,720.00
	合计	19,840,720.00	87,491.71	19,915,491.71	-12,720.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	806,142,054.13	87,491.71	827,493,707.16	21,264,161.32

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	134,494,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	134,494,000.00	-

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

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	232.61	223.41
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,316,734.61	3,068,964.36
其中：交易所市场	1,316,334.61	3,068,964.36
银行间市场	400.00	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	1,496,967.22	3,249,187.77

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	672,211,865.59	672,211,865.59
本期申购	289,942,907.66	289,942,907.66
本期赎回（以“-”号填列）	-530,582,313.97	-530,582,313.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	431,572,459.28	431,572,459.28

注：申购含红利再投、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
上年度末	625,697,541.29	-264,524,249.94	361,173,291.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	625,697,541.29	-264,524,249.94	361,173,291.35
本期利润	-172,924,079.13	-16,784,192.70	-189,708,271.83
本期基金份额交易产生的变动数	-60,132,489.07	101,080,850.00	40,948,360.93
其中：基金申购款	232,498,464.01	-121,101,608.67	111,396,855.34
基金赎回款	-292,630,953.08	222,182,458.67	-70,448,494.41
本期已分配利润	-207,806,683.22	-	-207,806,683.22
本期末	184,834,289.87	-180,227,592.64	4,606,697.23

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	863,222.70	573,991.48
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	97,626.71	49,168.60
其他	25,956.77	41,440.28
合计	986,806.18	664,600.36

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-165,706,515.53	-24,846,255.73
股票投资收益——赎回差价收入	-	-

股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-165,706,515.53	-24,846,255.73

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,349,906,079.73	4,300,773,656.20
减：卖出股票成本总额	8,492,769,952.70	4,312,918,655.18
减：交易费用	22,842,642.56	12,701,256.75
买卖股票差价收入	-165,706,515.53	-24,846,255.73

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	77,675.50	104,801.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-122,048.20	-13,106.28
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-44,372.70	91,694.73

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月

	日	31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,893,431.36	20,305,648.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,842,478.47	20,165,247.38
减：应计利息总额	172,201.09	153,106.90
减：交易费用	800.00	400.29
买卖债券差价收入	-122,048.20	-13,106.28

7.4.7.15.3 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。

7.4.7.15.4 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。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 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。

7.4.7.16.2 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。

7.4.7.16.3 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。

7.4.7.16.4 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。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 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。

7.4.7.17.2 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。

7.4.7.17.3 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。

7.4.7.17.4 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。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 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。

7.4.7.18.2 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。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,373,592.56	3,483,219.56
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	5,373,592.56	3,483,219.56

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-16,784,192.70	-6,581,962.89
股票投资	-16,796,912.70	-6,590,002.89
债券投资	12,720.00	8,040.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	-16,784,192.70	-6,581,962.89

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	632,202.16	59,920.13

基金转换费收入	503.02	534.70
合计	632,705.18	60,454.83

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）的投资人收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%归基金财产，其余用于支付注册登记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。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未计提信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,100.41	680.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	218,300.41	217,880.00

7.4.7.24 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、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
天府清源控股有限公司（“天府清控”）	基金管理人的股东
北京天朗云创信息技术有限公司（“天朗云创”）	基金管理人的股东

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.于 2023 年 4 月 3 日，诺德基金管理有限公司的股东宜信惠民投资管理(北京)有限公司名称变更为宜信惠民科技发展(北京)有限公司。于 2023 年 9 月 22 日，宜信惠民科技发展(北京)有限公司名称变更为北京天朗云创信息技术有限公司。

3.根据诺德基金管理有限公司于 2024 年 1 月 12 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会证监许可〔2024〕38 号文核准，诺德基金管理有限公司实际控制人变更为四川省能源投资集团有限责任公司。本次实际控制人变更不涉及诺德基金管理有限公司注册资本变更、不涉及诺德基金管理有限公司股权结构变更。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 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 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,967,157.17	8,161,050.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,359,368.20	1,122,952.83
应支付基金管理人的净管理费	10,607,788.97	7,038,097.21

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 21 日,支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

根据《诺德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，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 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,994,526.15	1,360,175.01

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 21 日，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 X 0.25% / 当年天数。

根据《诺德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，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 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	112,248,535.60	863,222.70	196,563,972.95	573,991.48

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。

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

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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 5 月 29 日	-	2023 年 5 月 29 日	2.6100	166,651,028.15	41,155,655.07	207,806,683.22	-
合计	-	-	-	2.6100	166,651,028.15	41,155,655.07	207,806,683.22	-

7.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末无因认购新发/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

本报告期末本基金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

本基金本报告期末无参与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

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人创造风险收益比合理、超越业绩比较基准的回报。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：(1) 决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；(2) 执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3) 监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有债券(2022 年 12 月 31 日：未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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 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。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。

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 2023 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							
货币资金	112,248,535.60	-	-	-	-	-	112,248,535.60
结算备付金	1,636,444.16	-	-	-	-	-	1,636,444.16
存出保证金	590,454.09	-	-	-	-	-	590,454.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	343,371,748.57	343,371,748.57
应收申购款	-	-	-	-	-	69,082.37	69,082.37
资产总计	114,475,433.85	-	-	-	-	343,440,830.94	457,916,264.79
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	190,015.71	190,015.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	462,666.78	462,666.78
应付托管费	-	-	-	-	-	77,111.13	77,111.13
应付清算款	-	-	-	-	-	19,510,347.44	19,510,347.44
其他负债	-	-	-	-	-	1,496,967.22	1,496,967.22
负债总计	-	-	-	-	-	21,737,108.28	21,737,108.28
利率敏感度缺口	114,475,433.85	-	-	-	-	321,703,722.66	436,179,156.51
上年度末 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							
货币资金	196,563,972.95	-	-	-	-	-	196,563,972.95
结算备付金	9,604,506.41	-	-	-	-	-	9,604,506.41
存出保证金	502,923.70	-	-	-	-	-	502,923.70
交易性金融资产	-	19,915,491.71	-	-	-	807,578,215.45	827,493,707.16
买入返售金融资产	134,494,000.00	-	-	-	-	-	134,494,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	75,120.10	75,120.10
资产总计	341,165,403.06	19,915,491.71	-	-	-	807,653,335.55	1,168,734,230.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	121,570.70	121,570.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,645,274.02	1,645,274.02
应付托管费	-	-	-	-	-	274,212.36	274,212.36
应付清算款	-	-	-	-	-	130,058,828.53	130,058,828.53
其他负债	-	-	-	-	-	3,249,187.77	3,249,187.77
负债总计	-	-	-	-	-	135,349,073.38	135,349,073.38
利率敏感度缺口	341,165,403.06	19,915,491.71	-	-	-	672,304,262.17	1,033,385,156.94

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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：1.93%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；债券及其他货币市场工具占基金资产的 0-35%；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。

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022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	343,371,748.57	78.72	807,578,215.45	78.15
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	343,371,748.57	78.72	807,578,215.45	78.15

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	12,808,400.93	31,141,061.70
	沪深 300 指数下降 5%	-12,808,400.93	-31,141,061.70

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	343,371,748.57	807,483,703.67
第二层次	-	19,915,491.71
第三层次	-	94,511.78
合计	343,371,748.57	827,493,707.16

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股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	94,511.78	94,511.78
当期购买	0.00	0.00	0.00
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	118,540.51	118,540.51
当期利得或损失总额	0.00	24,028.73	24,028.73
其中：计入损益的利得或损失	0.00	24,028.73	24,028.73
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	0.00	0.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	0.00	0.00
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	42,728,337.72	42,728,337.72
当期购买	0.00	78,909.17	78,909.17
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	43,736,444.52	43,736,444.52
当期利得或损失总额	0.00	1,023,709.41	1,023,709.41
其中：计入损益的利得或损失	0.00	1,023,709.41	1,023,709.41
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	94,511.78	94,511.78

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	15,602.61	15,602.61

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2022 年 12 月 31 日：本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022 年度：同）。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	94,511.78	平均价格亚式期权模型	预期波动率	23.19%-53.12%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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（2022 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	343,371,748.57	74.99
	其中：股票	343,371,748.57	74.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	113,884,979.76	24.87
8	其他各项资产	659,536.46	0.14
9	合计	457,916,264.79	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

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	15,126,952.37	3.47
B	采矿业	4,079,073.90	0.94
C	制造业	247,299,718.21	56.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,388,169.80	1.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,725,862.24	1.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	41,795,985.16	9.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,707,684.84	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,248,302.05	4.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	343,371,748.57	78.72

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	3,656,162	20,986,369.88	4.81
2	601398	工商银行	4,353,476	20,809,615.28	4.77
3	600519	贵州茅台	10,054	17,353,204.00	3.98
4	000568	泸州老窖	88,112	15,809,055.04	3.62
5	000661	长春高新	101,142	14,746,503.60	3.38
6	002311	海大集团	327,547	14,710,135.77	3.37
7	300274	阳光电源	144,098	12,621,543.82	2.89
8	300896	爱美客	31,702	9,330,849.66	2.14
9	603712	七一二	274,712	8,656,175.12	1.98
10	601233	桐昆股份	568,969	8,608,500.97	1.97
11	603806	福斯特	335,349	8,138,920.23	1.87
12	002044	美年健康	1,352,713	8,129,805.13	1.86
13	301155	海力风电	136,019	8,045,523.85	1.84
14	002738	中矿资源	213,400	7,961,954.00	1.83
15	002714	牧原股份	185,101	7,622,459.18	1.75
16	002487	大金重工	251,067	6,683,403.54	1.53
17	002100	天康生物	761,214	6,675,846.78	1.53
18	002567	唐人神	885,900	6,644,250.00	1.52
19	300750	宁德时代	40,600	6,628,356.00	1.52
20	603225	新凤鸣	465,256	6,606,635.20	1.51
21	300769	德方纳米	92,700	5,657,481.00	1.30
22	300244	迪安诊断	230,032	5,477,061.92	1.26
23	600258	首旅酒店	302,552	4,725,862.24	1.08
24	002497	雅化集团	343,175	4,492,160.75	1.03
25	600763	通策医疗	58,300	4,457,035.00	1.02
26	002985	北摩高科	127,330	4,415,804.40	1.01
27	603290	斯达半导	24,300	4,398,300.00	1.01
28	600803	新奥股份	260,890	4,388,169.80	1.01
29	300910	瑞丰新材	95,276	4,376,979.44	1.00
30	002252	上海莱士	545,847	4,366,776.00	1.00
31	300498	温氏股份	212,969	4,272,158.14	0.98
32	000513	丽珠集团	121,200	4,243,212.00	0.97
33	000768	中航西飞	188,300	4,212,271.00	0.97
34	601088	中国神华	130,114	4,079,073.90	0.94
35	603055	台华新材	285,102	3,432,628.08	0.79
36	605296	神农集团	105,185	3,232,335.05	0.74
37	688389	普门科技	139,370	3,137,218.70	0.72

38	301096	百诚医药	47,450	3,088,995.00	0.71
39	002011	盾安环境	223,000	3,066,250.00	0.70
40	002459	晶澳科技	130,200	2,697,744.00	0.62
41	000400	许继电气	107,577	2,362,390.92	0.54
42	300841	康华生物	29,100	2,256,414.00	0.52
43	601865	福莱特	84,000	2,242,800.00	0.51
44	600522	中天科技	179,160	2,237,708.40	0.51
45	688016	心脉医疗	11,458	2,230,070.54	0.51
46	688599	天合光能	77,360	2,207,080.80	0.51
47	002028	思源电气	42,300	2,201,292.00	0.50
48	301239	普瑞眼科	25,400	2,184,400.00	0.50
49	301367	怡和嘉业	17,869	2,175,550.75	0.50
50	603606	东方电缆	50,100	2,141,775.00	0.49
51	600862	中航高科	96,300	2,133,045.00	0.49
52	002068	黑猫股份	183,300	2,126,280.00	0.49
53	600529	山东药玻	82,955	2,123,648.00	0.49
54	002179	中航光电	54,200	2,113,800.00	0.48
55	603197	保隆科技	35,770	2,017,428.00	0.46
56	688266	泽璟制药-U	29,149	1,543,148.06	0.35
57	600557	康缘药业	73,809	1,514,560.68	0.35
58	000550	江铃汽车	74,328	1,414,461.84	0.32
59	688035	德邦科技	25,186	1,343,924.96	0.31
60	301080	百普赛斯	22,236	1,310,589.84	0.30
61	301257	普蕊斯	20,600	1,308,100.00	0.30
62	688489	三未信安	27,649	1,300,055.98	0.30
63	600298	安琪酵母	28,474	1,001,715.32	0.23
64	603255	鼎际得	23,391	872,484.30	0.20
65	600399	抚顺特钢	565	5,491.80	0.00
66	600129	太极集团	100	4,646.00	0.00
67	301345	涛涛车业	49	2,984.10	0.00
68	600150	中国船舶	100	2,944.00	0.00
69	688596	正帆科技	67	2,655.21	0.00
70	300354	东华测试	40	1,986.80	0.00
71	301363	美好医疗	46	1,692.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	245,400,415.70	23.75
2	601398	工商银行	211,359,316.00	20.45
3	000661	长春高新	207,980,514.40	20.13
4	601288	农业银行	174,791,131.00	16.91

5	688599	天合光能	174,230,841.96	16.86
6	300595	欧普康视	165,900,839.86	16.05
7	300274	阳光电源	158,127,842.01	15.30
8	600809	山西汾酒	146,456,044.02	14.17
9	601012	隆基绿能	136,896,346.88	13.25
10	300957	贝泰妮	128,799,220.04	12.46
11	600519	贵州茅台	122,166,333.07	11.82
12	002459	晶澳科技	120,423,387.92	11.65
13	601006	大秦铁路	109,652,517.00	10.61
14	301155	海力风电	101,146,848.90	9.79
15	601600	中国铝业	101,024,848.00	9.78
16	600258	首旅酒店	93,040,055.82	9.00
17	000001	平安银行	89,679,586.41	8.68
18	605117	德业股份	89,023,725.27	8.61
19	600298	安琪酵母	82,780,439.06	8.01
20	603212	赛伍技术	82,208,791.34	7.96
21	002487	大金重工	79,670,894.74	7.71
22	600572	康恩贝	75,939,003.20	7.35
23	600557	康缘药业	66,282,255.95	6.41
24	600763	通策医疗	64,206,778.95	6.21
25	600702	舍得酒业	62,517,461.80	6.05
26	300750	宁德时代	62,311,991.09	6.03
27	300763	锦浪科技	61,569,739.00	5.96
28	601233	桐昆股份	58,224,643.48	5.63
29	603806	福斯特	57,898,574.44	5.60
30	002311	海大集团	57,421,403.77	5.56
31	300979	华利集团	55,804,669.00	5.40
32	600138	中青旅	54,778,197.15	5.30
33	603712	七一二	52,064,892.44	5.04
34	600989	宝丰能源	51,849,282.00	5.02
35	300850	新强联	51,187,031.62	4.95
36	300498	温氏股份	51,057,673.34	4.94
37	300841	康华生物	49,872,115.15	4.83
38	002475	立讯精密	45,880,767.46	4.44
39	603985	恒润股份	45,817,047.40	4.43
40	600529	山东药玻	45,179,901.00	4.37
41	002920	德赛西威	43,582,466.40	4.22
42	601000	唐山港	42,966,260.08	4.16
43	000100	TCL 科技	42,218,485.00	4.09
44	301103	何氏眼科	42,182,921.74	4.08
45	600027	华电国际	41,220,746.77	3.99
46	000799	酒鬼酒	40,835,227.56	3.95
47	688223	晶科能源	40,763,034.90	3.94

48	601328	交通银行	40,683,115.00	3.94
49	688363	华熙生物	40,092,421.06	3.88
50	300223	北京君正	39,595,698.45	3.83
51	000858	五 粮 液	39,138,136.00	3.79
52	688680	海优新材	37,868,793.60	3.66
53	600908	无锡银行	37,702,564.74	3.65
54	603345	安井食品	36,688,118.32	3.55
55	601865	福莱特	35,746,811.00	3.46
56	600642	申能股份	35,493,254.35	3.43
57	002705	新宝股份	34,680,540.32	3.36
58	000960	锡业股份	34,555,725.64	3.34
59	300911	亿田智能	34,494,894.53	3.34
60	300122	智飞生物	33,853,669.00	3.28
61	002179	中航光电	33,833,837.47	3.27
62	300416	苏试试验	31,469,615.26	3.05
63	601668	中国建筑	31,412,023.96	3.04
64	002967	广电计量	31,208,240.00	3.02
65	601390	中国中铁	30,749,011.00	2.98
66	000878	云南铜业	30,466,399.00	2.95
67	000516	国际医学	30,390,511.00	2.94
68	688556	高测股份	30,363,944.08	2.94
69	601577	长沙银行	30,311,870.00	2.93
70	601991	大唐发电	29,985,798.00	2.90
71	600750	江中药业	29,725,217.00	2.88
72	300144	宋城演艺	29,371,531.00	2.84
73	600862	中航高科	28,908,736.28	2.80
74	600350	山东高速	28,831,973.22	2.79
75	000933	神火股份	28,749,338.00	2.78
76	688356	键凯科技	28,672,298.55	2.77
77	002865	钧达股份	28,581,847.35	2.77
78	002812	恩捷股份	28,083,365.00	2.72
79	002271	东方雨虹	27,400,906.00	2.65
80	002262	恩华药业	27,340,772.00	2.65
81	002966	苏州银行	27,055,541.30	2.62
82	000725	京东方 A	26,769,340.00	2.59
83	002142	宁波银行	26,493,508.78	2.56
84	002511	中顺洁柔	26,263,425.00	2.54
85	002979	雷赛智能	26,113,214.16	2.53
86	603225	新凤鸣	25,899,227.37	2.51
87	600754	锦江酒店	25,868,845.00	2.50
88	688123	聚辰股份	25,855,984.98	2.50
89	300760	迈瑞医疗	25,300,007.00	2.45
90	688008	澜起科技	24,963,930.26	2.42

91	002372	伟星新材	23,810,762.00	2.30
92	600458	时代新材	23,720,781.29	2.30
93	603290	斯达半导	23,328,776.00	2.26
94	002851	麦格米特	22,786,281.00	2.21
95	600256	广汇能源	22,504,868.00	2.18
96	000977	浪潮信息	21,798,965.00	2.11
97	000301	东方盛虹	21,471,108.71	2.08
98	600188	兖矿能源	21,440,319.00	2.07
99	688032	禾迈股份	21,303,961.94	2.06
100	600392	盛和资源	21,202,344.00	2.05
101	600004	白云机场	21,137,118.09	2.05
102	601166	兴业银行	20,810,134.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	292,836,720.27	28.34
2	601288	农业银行	265,548,260.86	25.70
3	300595	欧普康视	229,456,338.74	22.20
4	601398	工商银行	216,987,395.08	21.00
5	688599	天合光能	206,644,062.64	20.00
6	601012	隆基绿能	192,837,590.32	18.66
7	300274	阳光电源	191,174,793.84	18.50
8	000661	长春高新	180,775,081.58	17.49
9	300957	贝泰妮	156,434,590.67	15.14
10	600519	贵州茅台	154,974,732.33	15.00
11	600809	山西汾酒	146,028,962.81	14.13
12	002487	大金重工	119,741,846.40	11.59
13	002459	晶澳科技	111,978,783.01	10.84
14	601006	大秦铁路	109,423,532.82	10.59
15	601600	中国铝业	99,820,115.24	9.66
16	600298	安琪酵母	96,719,747.87	9.36
17	301155	海力风电	89,399,033.26	8.65
18	000001	平安银行	88,676,530.21	8.58
19	600258	首旅酒店	85,714,106.38	8.29
20	605117	德业股份	84,590,912.70	8.19
21	603212	赛伍技术	79,086,440.99	7.65
22	688680	海优新材	77,186,554.68	7.47
23	600572	康恩贝	76,630,682.83	7.42
24	600557	康缘药业	69,685,362.66	6.74
25	688363	华熙生物	63,064,606.61	6.10
26	600702	舍得酒业	59,491,816.94	5.76

27	600989	宝丰能源	59,355,687.23	5.74
28	300763	锦浪科技	55,921,664.55	5.41
29	300979	华利集团	55,268,117.36	5.35
30	600138	中青旅	54,954,588.68	5.32
31	600763	通策医疗	53,219,771.68	5.15
32	300750	宁德时代	53,180,150.69	5.15
33	601233	桐昆股份	50,904,193.73	4.93
34	603806	福斯特	49,011,824.28	4.74
35	300841	康华生物	46,129,241.39	4.46
36	300850	新强联	44,545,383.07	4.31
37	300498	温氏股份	44,407,239.10	4.30
38	002475	立讯精密	44,132,516.11	4.27
39	002920	德赛西威	44,024,159.51	4.26
40	601000	唐山港	43,514,957.02	4.21
41	603985	恒润股份	43,282,824.57	4.19
42	600529	山东药玻	42,952,292.44	4.16
43	000100	TCL 科技	42,303,202.72	4.09
44	603712	七一二	41,811,434.10	4.05
45	600027	华电国际	40,979,538.52	3.97
46	000799	酒鬼酒	40,292,413.25	3.90
47	301103	何氏眼科	39,740,550.13	3.85
48	688223	晶科能源	38,633,777.60	3.74
49	002311	海大集团	38,223,390.98	3.70
50	000858	五 粮 液	37,587,121.00	3.64
51	600642	申能股份	37,264,420.65	3.61
52	600908	无锡银行	36,839,935.43	3.56
53	300223	北京君正	36,737,957.31	3.56
54	603345	安井食品	35,390,372.47	3.42
55	601390	中国中铁	34,181,488.18	3.31
56	002705	新宝股份	33,752,813.45	3.27
57	300122	智飞生物	33,424,302.47	3.23
58	600350	山东高速	32,703,904.10	3.16
59	002979	雷赛智能	32,474,036.38	3.14
60	300911	亿田智能	31,760,945.54	3.07
61	000960	锡业股份	31,565,386.11	3.05
62	601991	大唐发电	31,493,067.65	3.05
63	601865	福莱特	30,760,924.12	2.98
64	601668	中国建筑	30,728,703.02	2.97
65	000878	云南铜业	30,532,504.31	2.95
66	000933	神火股份	30,443,072.45	2.95
67	601577	长沙银行	30,330,708.78	2.94
68	688111	金山办公	30,276,643.36	2.93
69	002179	中航光电	29,771,454.74	2.88

70	688556	高测股份	29,267,767.81	2.83
71	300144	宋城演艺	29,128,564.71	2.82
72	000516	国际医学	29,032,091.38	2.81
73	002967	广电计量	28,778,025.70	2.78
74	688356	键凯科技	28,559,256.62	2.76
75	600750	江中药业	28,341,248.88	2.74
76	300416	苏试试验	28,295,420.18	2.74
77	002812	恩捷股份	28,061,623.87	2.72
78	600862	中航高科	27,784,512.78	2.69
79	002865	钧达股份	27,604,997.61	2.67
80	002271	东方雨虹	27,250,419.02	2.64
81	002262	恩华药业	27,056,110.66	2.62
82	002966	苏州银行	26,455,348.54	2.56
83	002142	宁波银行	26,238,119.82	2.54
84	002511	中顺洁柔	25,849,481.88	2.50
85	000725	京东方 A	25,690,640.13	2.49
86	300662	科锐国际	25,254,376.96	2.44
87	688123	聚辰股份	24,530,081.19	2.37
88	600754	锦江酒店	24,508,103.20	2.37
89	300760	迈瑞医疗	24,408,900.59	2.36
90	688268	华特气体	23,828,083.60	2.31
91	600392	盛和资源	23,604,603.70	2.28
92	002372	伟星新材	23,584,688.24	2.28
93	600458	时代新材	23,227,549.02	2.25
94	002851	麦格米特	22,926,777.87	2.22
95	688008	澜起科技	22,807,188.64	2.21
96	002897	意华股份	22,517,354.78	2.18
97	600256	广汇能源	22,467,247.32	2.17
98	600399	抚顺特钢	22,333,598.15	2.16
99	000977	浪潮信息	21,386,919.15	2.07
100	000301	东方盛虹	20,989,184.92	2.03
101	600004	白云机场	20,924,870.00	2.02
102	003012	东鹏控股	20,920,686.70	2.02
103	688032	禾迈股份	20,837,922.59	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,045,360,398.52
卖出股票收入（成交）总额	8,349,906,079.73

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金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 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	590,454.09
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,082.37

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	659,536.46

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§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（%）
18,498	23,330.76	299,075,854.00	69.30	132,496,605.28	30.70

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	1,295.95	0.00

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（2009 年 9 月 22 日）基金份额总额	514,662,125.54
本报告期期初基金份额总额	672,211,865.59

本报告期基金总申购份额	289,942,907.66
减：本报告期基金总赎回份额	530,582,313.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	431,572,459.28

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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 2023 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 15 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东方财富	2	1,626,318,451.65	9.92	1,192,286.45	8.61	-
中国国际金融股份有限公司	1	1,589,823,595.23	9.70	1,481,843.31	10.70	-
东吴证券	1	1,415,694,242.17	8.63	1,321,395.43	9.55	-
申港证券	2	1,370,244,628.74	8.36	1,003,524.40	7.25	-
中信证券	3	1,284,640,768.69	7.84	939,465.34	6.79	-
华创证券	1	1,118,251,700.39	6.82	1,041,426.76	7.52	-
长江证券	1	1,110,538,769.15	6.77	1,034,238.04	7.47	-
中信建投	2	828,361,676.67	5.05	681,767.67	4.92	-
兴业证券	2	619,393,681.27	3.78	577,228.67	4.17	-
中泰证券	1	571,404,265.43	3.49	535,651.12	3.87	-
天风证券	1	497,818,303.45	3.04	465,397.91	3.36	-
国盛证券	2	487,093,651.83	2.97	360,364.16	2.60	-
海通证券	1	419,269,059.49	2.56	390,594.50	2.82	-
民生证券	2	389,209,991.25	2.37	284,627.85	2.06	-
东亚前海	2	380,349,426.53	2.32	280,209.82	2.02	-
华宝证券	2	357,192,035.26	2.18	261,204.85	1.89	-
国金证券	2	326,145,415.23	1.99	241,148.72	1.74	-
国信证券	2	302,310,617.06	1.84	282,963.43	2.04	-
西南证券	2	267,656,808.26	1.63	250,370.38	1.81	-
国泰君安	3	224,903,238.	1.37	164,471.55	1.19	-

		72				
银河证券	2	210,635,031.40	1.28	196,164.11	1.42	-
英大证券	2	151,038,171.38	0.92	110,454.16	0.80	-
浙商证券	1	120,735,847.55	0.74	114,205.47	0.82	-
中邮证券	1	119,799,738.90	0.73	87,697.09	0.63	-
东海证券	2	115,107,581.08	0.70	84,180.11	0.61	-
广发证券	1	111,761,989.91	0.68	104,453.75	0.75	-
国都证券	1	101,774,344.35	0.62	96,268.24	0.70	-
太平洋证券	1	101,738,084.22	0.62	94,749.04	0.68	-
方正证券	1	90,984,164.60	0.55	84,733.84	0.61	-
招商证券	1	85,067,532.15	0.52	80,469.59	0.58	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

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

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1)基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：英大证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东亚前海证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司。退租交易单元：平安证券股份有限公司、大同证券股份有限公司、华西证券股份有限公司。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德成长优势混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2023 年 1 月 20 日
2	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 1 月 20 日
3	诺德成长优势混合型证券投资基金 2022 年年度报告	指定互联网网站	2023 年 3 月 31 日
4	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 3 月 31 日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海长量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	2023 年 4 月 14 日
6	关于诺德成长优势混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期	证券日报、指定互联网网站	2023 年 4 月 15 日

	定额投资）业务的公告		
7	诺德成长优势混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2023 年 4 月 22 日
8	诺德基金管理有限公司关于诺德成长优势混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券日报、指定互联网网站	2023 年 4 月 22 日
9	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 4 月 22 日
10	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海攀赢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	2023 年 4 月 27 日
11	诺德成长优势混合型证券投资基金分红公告	证券日报、指定互联网网站	2023 年 5 月 27 日
12	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加金元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	2023 年 7 月 19 日
13	诺德成长优势混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定互联网网站	2023 年 7 月 21 日
14	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 7 月 21 日
15	诺德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
16	诺德成长优势混合型证券投资基金托管协议	指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
17	诺德成长优势混合型证券投资基金基金合同	指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
18	诺德成长优势混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定互联网网站	2023 年 8 月 23 日
19	诺德成长优势混合型证券投资基金招募说明书（更新）	指定互联网网站	2023 年 8 月 23 日
20	诺德成长优势混合型证券投资基金 2023 年中期报告	指定互联网网站	2023 年 8 月 31 日
21	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 8 月 31 日
22	诺德基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告	证券日报、中国证券报、证券时报、指定互联网网站	2023 年 9 月 19 日
23	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通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	2023 年 9 月 27 日

24	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	2023 年 9 月 28 日
25	诺德成长优势混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定互联网网站	2023 年 9 月 28 日
26	诺德成长优势混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年 9 月）	指定互联网网站	2023 年 9 月 28 日
27	诺德成长优势混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定互联网网站	2023 年 10 月 25 日
28	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年 3 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 10 月 25 日
29	诺德基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 12 月 7 日
30	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加银泰证券有限责任公司申购（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	2023 年 12 月 8 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

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	20230307 - 20230413	79,294,713.66	64,640,594.70	143,935,308.36	0.00	0.00
	2	20230912 - 20231231	114,692,089.53	0.00	0.00	114,692,089.53	26.58
产品特有风险							
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。 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。 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。							

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、中国证监会批准诺德成长优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、诺德成长优势混合型证券投资基金基金合同。

3、诺德成长优势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、诺德成长优势混合型证券投资基金 2023 年年度报告原文。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者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

2024 年 3 月 29 日