

诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 12 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 盈利投资者数量占比	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	46
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	诺德量化优选
基金主代码	005347
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 27 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	158,264,236.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，并在严格控制组合风险基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期稳健地增值。
投资策略	本基金通过量化基本面方法，“自上而下”与“自下而上”相结合，对经济情况、公司基本面、估值水平等情况进行深入分析研究，精选投资标的，构建投资组合。同时，对市场情绪、市场交易行为等方面进行分析研究，对市场走势及个股价格走势进行合理预判，动态调整投资组合中个股的仓位，进行积极的组合管理与风险控制，力争实现基金资产的长期增值及稳健的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邵天婷	王茵
	联系电话	021-68985056	010-63639180
	电子邮箱	tianting.shao@nuodefund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-888-0009	95595
传真		021-68985121	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑成武	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nuodefund.com

基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所
------------	---------------

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,276,238.95
本期利润	256,285.55
加权平均基金份额本期利润	0.0015
本期加权平均净值利润率	0.19%
本期基金份额净值增长率	-0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-37,297,686.82
期末可供分配基金份额利润	-0.2357
期末基金资产净值	120,966,549.67
期末基金份额净值	0.7643
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-23.57%

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 2020 年 8 月 27 日。

3.2 基金净值表现

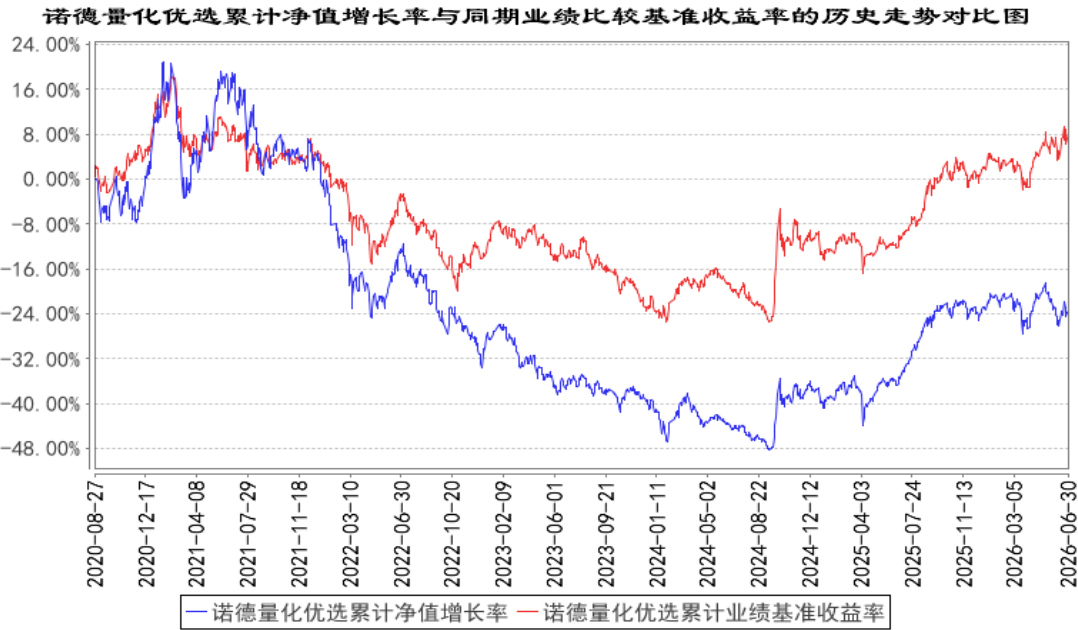
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.45%	1.07%	9.63%	1.01%	-7.18%	0.06%
过去六个月	-0.27%	1.04%	6.31%	0.91%	-6.58%	0.13%

过去一年	17.28%	0.88%	20.81%	0.81%	-3.53%	0.07%
过去三年	19.53%	1.01%	25.21%	0.89%	-5.68%	0.12%
过去五年	-35.46%	1.10%	-0.95%	0.89%	-34.51%	0.21%
自基金合同生效起至今	-23.57%	1.18%	8.13%	0.90%	-31.70%	0.28%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*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 2020 年 8 月 27 日，图示时间段为 2020 年 8 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日。
本基金建仓期间自 2020 年 8 月 27 日至 2021 年 2 月 26 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为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，公司管理了四十四只开放式基金：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、诺德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、诺德安锦利率债债券型证券投资基金、诺德安悦债券型证券投资基金、诺德丰景 90 天持有期债券型证券投资基金、诺德华证价值优选 50 指数型发起式证券投资基金。

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		
曾文宏	本基金基金经理、诺德量化蓝筹增强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基金经理	2023 年 7 月 14 日	-	14 年	华中师范大学数量经济学硕士。2012 年 6 月至 2014 年 7 月于上海大智慧股份有限公司担任行业研究员兼产品经理，2014 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业部高级研究员, FOF 管理部投资经理等职务，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、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内宏观延续复苏态势，基本面持续改善，复苏进程逐步推进。国际方面，美联储下一步是否降息存在分歧，地缘冲突带来的能源价格脉冲对通胀影响较大。

上半年，股票市场整体震荡上行，但风格层面分化进一步加剧，呈现出“K”型走势。进入 6 月，硬科技成长表现持续占优，与此同时，其余板块面临流动性挤压效应较为明显，虹吸效应较为突出。不过，进入三季度后，这一分化格局有望阶段性缓解。

从结构上看，上半年通信，电子等硬科技成长方向表现较为极致，本基金一直采用的基本面量化策略、个股择时策略与市场短期节奏存在一定偏差。未来，我们仍将坚持以基本面研究和多因子选股相结合的投资框架，不会因短期市场风格的极致演绎而调整长期坚持的投资逻辑。操作层面上本基金将依旧维持一定程度的个股分散度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7643 元，累计净值为 0.7643 元。本报告期份额净值增长率为-0.27%，同期业绩比较基准增长率为 6.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点，我们认为 A 股市场或依旧存在较大机会。方向上，将继续关注业绩反转和业绩超预期的公司，同时对业绩存疑的个股保持审慎。风格层面，低位价值板块存在估值修复空间，同时科创板和创业板中具备真成长性的标的或已进入可布局区间。技术面上，指数已逐步走出长期底部区间，完成震荡筑底并呈现右侧回升态势。具体到下半年，我们相对看好能够较好受益于中国经济增长和资本市场发展的券商板块。在坚守价值投资理念的前提下，本基金将力争获取超越业绩基准的收益。

本基金将加强对相关行业及个股的研究深度和跟踪力度，组合构建上，通过数量化模型，合理配置资产权重，审慎精选个股，在严格控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳健增值。我们将积极把握市场机会，努力为持有人创造持续、稳健的回报。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,580,308.12	21,273,877.21
结算备付金		179,379.47	189,338.15

存出保证金		31,925.77	64,867.59
交易性金融资产	6.4.7.2	112,466,821.68	124,585,821.23
其中：股票投资		112,466,821.68	124,585,821.23
基金投资		-	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		603,450.76	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,426.21	1,098.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		121,863,312.01	146,115,002.68
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		239,273.91	-
应付赎回款		360,182.34	237,953.39
应付管理人报酬		121,111.15	149,185.64
应付托管费		20,185.20	24,864.27
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	6.4.7.9	156,009.74	206,378.84
负债合计		896,762.34	618,382.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	158,264,236.49	189,847,978.62
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-37,297,686.82	-44,351,358.08

净资产合计		120,966,549.67	145,496,620.54
负债和净资产总计		121,863,312.01	146,115,002.68

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.7643 元，基金份额总额 158,264,236.49 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,307,060.63	7,656,637.14
1. 利息收入		18,754.62	82,380.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,754.62	73,585.07
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		-	8,795.84
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,308,259.41	4,955,575.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,140,428.59	4,069,784.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12.50	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,167,818.32	885,791.62
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）	6.4.7.20	-8,019,953.40	2,618,680.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		1,050,775.08	1,067,627.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	806,616.22	822,657.74

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	134, 436. 00	137, 109. 63
3. 销售服务费	6. 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	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	109, 722. 86	107, 860. 15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		256, 285. 55	6, 589, 009. 62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		256, 285. 55	6, 589, 009. 62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		256, 285. 55	6, 589, 009. 62

6.3 净资产变动表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	189, 847, 978. 62	-	-44, 351, 358. 08	145, 496, 620. 54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	189, 847, 978. 62	-	-44, 351, 358. 08	145, 496, 620. 54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31, 583, 742. 13	-	7, 053, 671. 26	-24, 530, 070. 87
（一）、综合收益总额	-	-	256, 285. 55	256, 285. 55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-31, 583, 742. 13	-	6, 797, 385. 71	-24, 786, 356. 42

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	936,926.14	-	-209,145.86	727,780.28
2. 基金赎回款	-32,520,668.27	-	7,006,531.57	-25,514,136.70
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	158,264,236.49	-	-37,297,686.82	120,966,549.67
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	232,918,425.85	-	-88,198,621.46	144,719,804.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,918,425.85	-	-88,198,621.46	144,719,804.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,426,310.02	-	13,491,315.61	-4,934,994.41
(一)、综合收益总额	-	-	6,589,009.62	6,589,009.62
(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)	-18,426,310.02	-	6,902,305.99	-11,524,004.03
其中：1. 基金申购款	958,788.31	-	-365,685.95	593,102.36
2. 基金赎回款	-19,385,098.33	-	7,267,991.94	-12,117,106.39

（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	214,492,115.83	-	-74,707,305.85	139,784,809.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘翔

刘翔

高奇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1411 号《关于准予诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,811,767,705.91 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(2020)第 0768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,812,340,657.17 份基金份额，其中认购资金利息折合 572,951.26 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可交换债券、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、

股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	8,580,308.12
等于：本金	8,579,334.86
加：应计利息	973.26
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	8,580,308.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		100,495,705.59	-	112,466,821.68	11,971,116.09
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		100,495,705.59	-	112,466,821.68	11,971,116.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	64,886.88
其中：交易所市场	64,886.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,122.86
合计	156,009.74

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	189,847,978.62	189,847,978.62
本期申购	936,926.14	936,926.14
本期赎回（以“-”号填列）	-32,520,668.27	-32,520,668.27
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	158,264,236.49	158,264,236.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

不适用。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,731,189.36	-9,620,168.72	-44,351,358.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-34,731,189.36	-9,620,168.72	-44,351,358.08
本期利润	8,276,238.95	-8,019,953.40	256,285.55
本期基金份额交易产生的变动数	5,003,338.41	1,794,047.30	6,797,385.71
其中：基金申购款	-148,661.72	-60,484.14	-209,145.86
基金赎回款	5,152,000.13	1,854,531.44	7,006,531.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,451,612.00	-15,846,074.82	-37,297,686.82

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,515.88
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	163.81
其他	74.93
合计	18,754.62

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	108,800,964.54
减：卖出股票成本总额	100,503,537.68
减：交易费用	156,998.27
买卖股票差价收入	8,140,428.59

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12.50
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	12.50

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	—
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	—
减：应计利息总额	—
减：交易费用	-12.50
买卖债券差价收入	12.50

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,167,818.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,167,818.32

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,019,953.40
股票投资	-8,019,953.40
债券投资	-
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	-8,019,953.40

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	27,900.00
合计	109,722.86

6.4.7.24 分部报告

不适用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	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. 根据诺德基金管理有限公司于 2026 年 1 月 5 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会证监许可(2025)2968 号文核准，诺德基金管理有限公司实际控制人变更为四川能源发展集团有限责任公司。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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	806,616.22	822,657.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	311,097.04	313,493.06
应支付基金管理人的净管理费	495,519.18	509,164.68

注：支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,436.00	137,109.63

注：支付基金托管人中国光大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。

6.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	8,580,308.12	18,515.88	23,039,985.93	73,043.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
001248	华润新 能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
603137	恒尚 节能	2026 年 6 月 16 日	重大事 项停牌	12.94	2026 年 7 月 1 日	14.23	11,800	120,465.00	152,692.00	-

注：本基金截至 2026 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，属于风险较高、收益较高风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。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超越业绩比较基准的长期稳定回报。

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

体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3)监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发

行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,580,308.12	-	-	-	-	-	8,580,308.12
结算备付金	179,379.47	-	-	-	-	-	179,379.47
存出保证金	31,925.77	-	-	-	-	-	31,925.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	112,466,821.68	112,466,821.68
应收申购款	-	-	-	-	-	1,426.21	1,426.21
应收清算款	-	-	-	-	-	603,450.76	603,450.76
资产总计	8,791,613.36	-	-	-	-	113,071,698.65	121,863,312.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	360,182.34	360,182.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	121,111.15	121,111.15
应付托管费	-	-	-	-	-	20,185.20	20,185.20
应付清算款	-	-	-	-	-	239,273.91	239,273.91
其他负债	-	-	-	-	-	156,009.74	156,009.74
负债总计	-	-	-	-	-	896,762.34	896,762.34
利率敏感度缺口	8,791,613.36	-	-	-	-	112,174,936.31	120,966,549.67
上年度末 2025 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	21,273,877.21	-	-	-	-	-	21,273,877.21
结算备付金	189,338.15	-	-	-	-	-	189,338.15
存出保证金	64,867.59	-	-	-	-	-	64,867.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	124,585,821.23	124,585,821.23
应收申购款	-	-	-	-	-	1,098.50	1,098.50
资产总计	21,528,082.95	-	-	-	-	124,586,919.73	146,115,002.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	237,953.39	237,953.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	149,185.64	149,185.64
应付托管费	-	-	-	-	-	24,864.27	24,864.27
其他负债	-	-	-	-	-	206,378.84	206,378.84
负债总计	-	-	-	-	-	618,382.14	618,382.14
利率敏感度缺口	21,528,082.95	-	-	-	-	123,968,536.59	145,496,620.54

□	5				7.59	54
---	---	--	--	--	------	----

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票，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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	112,466,821.68	92.97	124,585,821.23	85.63
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	112,466,821.68	92.97	124,585,821.23	85.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,850,153.81	6,612,821.40
	沪深 300 指数下降 5%	-4,850,153.81	-6,612,821.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	112,304,019.68	124,585,821.23

第二层次	162,802.00	—
第三层次	—	—
合计	112,466,821.68	124,585,821.23

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	112,466,821.68	92.29
	其中：股票	112,466,821.68	92.29
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	—	—

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	8,759,687.59	7.19
8	其他各项资产	636,802.74	0.52
9	合计	121,863,312.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	708,423.60	0.59
B	采矿业	2,287,156.00	1.89
C	制造业	51,327,457.10	42.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,759,446.00	2.28
E	建筑业	1,019,852.00	0.84
F	批发和零售业	1,019,245.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	1,172,489.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,023,743.35	2.50
J	金融业	42,597,274.63	35.21
K	房地产业	339,570.00	0.28
L	租赁和商务服务业	163,520.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	3,878,817.00	3.21
N	水利、环境和公共设施管理业	924,092.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	397,476.00	0.33
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	848,260.00	0.70
S	综合	-	-
	合计	112,466,821.68	92.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601211	国泰海通	344,354	6,267,242.80	5.18
2	600030	中信证券	217,645	6,252,940.85	5.17
3	300033	同花顺	22,560	5,436,960.00	4.49
4	000776	广发证券	217,400	5,087,160.00	4.21

5	300750	宁德时代	12,120	4,763,281.20	3.94
6	601108	财通证券	540,500	4,675,325.00	3.86
7	000333	美的集团	46,644	3,523,021.32	2.91
8	002967	广电计量	191,500	3,456,575.00	2.86
9	300059	东方财富	157,800	3,215,964.00	2.66
10	601398	工商银行	393,662	2,783,190.34	2.30
11	600276	恒瑞医药	53,367	2,777,218.68	2.30
12	600519	贵州茅台	2,251	2,668,537.99	2.21
13	600958	东方证券	278,100	2,625,264.00	2.17
14	002465	海格通信	200,409	2,559,222.93	2.12
15	002594	比亚迪	30,000	2,391,000.00	1.98
16	601198	东兴证券	150,696	2,047,958.64	1.69
17	600999	招商证券	96,000	2,025,600.00	1.67
18	600570	恒生电子	94,700	2,006,693.00	1.66
19	603977	国泰集团	100,854	1,665,099.54	1.38
20	601939	建设银行	169,600	1,633,248.00	1.35
21	600900	长江电力	45,000	1,191,150.00	0.98
22	601088	中国神华	30,000	1,171,200.00	0.97
23	603393	新天然气	54,000	1,156,140.00	0.96
24	300130	新国都	54,600	1,148,784.00	0.95
25	600188	兖矿能源	62,800	1,115,956.00	0.92
26	601595	上海电影	51,100	848,260.00	0.70
27	300877	金春股份	26,200	792,812.00	0.66
28	605298	必得科技	15,000	779,250.00	0.64
29	688379	华光新材	9,000	756,270.00	0.63
30	600676	久事动娱	100,000	649,000.00	0.54
31	605100	华丰股份	15,400	622,468.00	0.51
32	301057	汇隆新材	26,200	602,600.00	0.50
33	300970	华绿生物	32,370	591,723.60	0.49
34	601231	环旭电子	18,200	589,680.00	0.49
35	600768	宁波富邦	38,700	579,726.00	0.48
36	688251	井松智能	22,172	568,268.36	0.47
37	688448	磁谷科技	8,910	566,319.60	0.47
38	601519	大智慧	63,300	546,279.00	0.45
39	003017	大洋生物	22,920	527,160.00	0.44
40	688096	京源环保	39,200	523,712.00	0.43
41	300717	华信新材	24,100	513,330.00	0.42
42	688501	青达环保	26,400	506,880.00	0.42
43	688013	天臣医疗	20,500	505,735.00	0.42
44	301235	华康洁净	6,600	495,066.00	0.41
45	300816	艾可蓝	6,400	468,480.00	0.39
46	000932	华菱钢铁	133,000	461,510.00	0.38
47	688395	正弦电气	20,800	459,680.00	0.38

48	301300	远翔新材	13,900	436,043.00	0.36
49	603108	润达医疗	48,100	428,090.00	0.35
50	688163	赛伦生物	8,600	419,766.00	0.35
51	300819	聚杰微纤	5,500	407,110.00	0.34
52	600455	博通股份	18,100	397,476.00	0.33
53	001231	农心科技	20,900	381,216.00	0.32
54	600883	博闻科技	52,700	368,900.00	0.30
55	300971	博亚精工	19,600	365,736.00	0.30
56	001211	双枪科技	15,341	365,729.44	0.30
57	688111	金山办公	1,699	361,971.95	0.30
58	688056	莱伯泰科	5,600	361,480.00	0.30
59	002633	申科股份	23,500	355,555.00	0.29
60	603286	日盈电子	7,600	346,788.00	0.29
61	300535	达威股份	25,400	346,202.00	0.29
62	002188	中天服务	69,300	339,570.00	0.28
63	300995	奇德新材	12,500	335,125.00	0.28
64	300731	科创新源	5,740	334,986.40	0.28
65	301003	江苏博云	6,200	331,700.00	0.27
66	300611	美力科技	14,200	321,914.00	0.27
67	688092	爱科科技	15,100	320,724.00	0.27
68	300069	金利华电	9,900	315,117.00	0.26
69	002066	瑞泰科技	15,000	312,450.00	0.26
70	603637	镇海股份	19,800	302,148.00	0.25
71	301161	唯万密封	7,800	301,158.00	0.25
72	301007	德迈仕	9,600	293,760.00	0.24
73	301125	腾亚精工	20,300	291,508.00	0.24
74	300652	雷迪克	8,320	278,803.20	0.23
75	688768	容知日新	5,200	268,008.00	0.22
76	603926	铁流股份	14,800	261,812.00	0.22
77	603709	中源家居	19,000	257,260.00	0.21
78	688129	东来技术	9,800	256,662.00	0.21
79	001268	联合精密	7,200	255,024.00	0.21
80	301131	聚赛龙	7,800	250,614.00	0.21
81	688681	科汇股份	17,500	244,650.00	0.20
82	301279	金道科技	11,154	242,376.42	0.20
83	603269	海鸥股份	14,700	242,109.00	0.20
84	688667	菱电电控	1,800	240,570.00	0.20
85	600137	浪莎股份	14,500	235,335.00	0.19
86	688718	唯赛勃	14,600	233,162.00	0.19
87	688291	金橙子	3,900	228,072.00	0.19
88	301119	正强股份	9,240	226,749.60	0.19
89	603725	天安新材	19,800	223,740.00	0.18
90	300886	华业香料	11,000	218,900.00	0.18

91	002494	华斯股份	49,000	217,560.00	0.18
92	301023	奕帆传动	6,384	216,736.80	0.18
93	300509	新美星	25,400	212,852.00	0.18
94	600149	廊坊发展	47,000	211,030.00	0.17
95	603090	宏盛股份	4,000	204,240.00	0.17
96	002887	绿茵生态	19,000	198,930.00	0.16
97	600282	南钢股份	43,200	198,288.00	0.16
98	300907	康平科技	3,500	196,000.00	0.16
99	001202	炬申股份	14,300	193,765.00	0.16
100	001210	金房能源	8,400	191,016.00	0.16
101	002357	富临运业	21,000	186,900.00	0.15
102	300992	泰福泵业	7,400	184,482.00	0.15
103	688314	康拓医疗	5,400	182,952.00	0.15
104	601609	金田股份	16,900	182,520.00	0.15
105	001218	丽臣实业	8,200	180,892.00	0.15
106	301008	宏昌科技	7,000	179,200.00	0.15
107	300086	康芝药业	30,200	178,180.00	0.15
108	301283	聚胶股份	7,250	177,480.00	0.15
109	002836	新宏泽	19,200	177,408.00	0.15
110	603161	科华控股	12,800	169,856.00	0.14
111	688310	迈得医疗	11,000	169,070.00	0.14
112	002871	伟隆股份	7,500	167,325.00	0.14
113	301053	远信工业	4,480	165,312.00	0.14
114	002780	三夫户外	13,600	165,104.00	0.14
115	301158	德石股份	12,480	164,611.20	0.14
116	603829	洛凯股份	10,000	163,700.00	0.14
117	688529	豪森智能	10,400	163,592.00	0.14
118	001228	永泰运	6,400	163,520.00	0.14
119	300876	蒙泰高新	11,200	160,496.00	0.13
120	300789	唐源电气	9,000	159,930.00	0.13
121	002702	海欣食品	35,800	159,310.00	0.13
122	300644	南京聚隆	6,800	158,984.00	0.13
123	001336	楚环科技	7,200	158,544.00	0.13
124	300195	长荣股份	27,000	158,490.00	0.13
125	603137	恒尚节能	11,800	152,692.00	0.13
126	002802	洪汇新材	14,400	151,488.00	0.13
127	001234	泰慕士	7,400	145,336.00	0.12
128	300743	天地数码	9,800	142,982.00	0.12
129	002492	恒基达鑫	26,400	142,824.00	0.12
130	301287	康力源	4,400	142,076.00	0.12
131	600356	恒丰纸业	18,800	139,308.00	0.12
132	688466	金科环境	10,600	135,998.00	0.11
133	301353	普莱得	8,112	134,740.32	0.11

134	002949	华阳国际	13,000	128,570.00	0.11
135	600272	开开实业	12,600	127,764.00	0.11
136	603041	美思德	12,200	126,514.00	0.10
137	001278	一彬科技	8,200	126,116.00	0.10
138	301043	绿岛风	2,500	122,775.00	0.10
139	002999	天禾股份	22,800	121,296.00	0.10
140	000803	山高环能	17,800	120,684.00	0.10
141	603089	正裕工业	14,400	120,240.00	0.10
142	603282	亚光股份	8,400	119,868.00	0.10
143	003008	开普检测	7,000	119,490.00	0.10
144	301272	英华特	3,600	118,584.00	0.10
145	688557	兰剑智能	3,800	117,914.00	0.10
146	600097	开创国际	15,000	116,700.00	0.10
147	301107	瑜欣电子	5,292	112,719.60	0.09
148	301298	东利机械	9,600	111,072.00	0.09
149	301081	严牌股份	8,000	109,440.00	0.09
149	301126	达嘉维康	12,800	109,440.00	0.09
150	688080	映翰通	2,500	108,125.00	0.09
151	002826	易明医药	7,100	106,713.00	0.09
152	603860	中公高科	4,400	106,436.00	0.09
153	002873	新天药业	14,400	105,408.00	0.09
154	603937	丽岛新材	7,500	105,150.00	0.09
155	603908	牧高笛	5,800	97,904.00	0.08
156	300845	捷安高科	7,280	96,678.40	0.08
157	688435	英方软件	2,900	92,800.00	0.08
158	688113	联测科技	2,400	84,240.00	0.07
159	688517	金冠电气	4,800	83,904.00	0.07
160	605189	富春染织	6,890	83,024.50	0.07
161	688737	中自科技	4,300	82,302.00	0.07
162	301234	五洲医疗	2,500	82,225.00	0.07
163	603332	苏州龙杰	8,100	81,891.00	0.07
164	605155	西大门	6,600	78,144.00	0.06
165	605003	众望布艺	3,800	77,900.00	0.06
166	002209	达意隆	7,400	76,812.00	0.06
167	003023	彩虹集团	3,800	73,872.00	0.06
168	300906	日月明	2,900	72,297.00	0.06
169	001209	洪兴股份	4,500	72,090.00	0.06
170	688203	海正生材	7,200	71,856.00	0.06
171	603151	邦基科技	6,400	70,336.00	0.06
172	603909	建发合诚	8,200	69,946.00	0.06
173	301022	海泰科	3,100	69,936.00	0.06
174	301192	泰祥股份	3,700	69,930.00	0.06
175	688616	西力科技	6,900	69,690.00	0.06

176	603238	诺邦股份	6,300	69,300.00	0.06
177	603326	我乐家居	11,000	67,760.00	0.06
178	301390	经纬股份	2,100	67,746.00	0.06
179	600128	苏豪弘业	8,900	67,551.00	0.06
180	001260	坤泰股份	4,300	67,295.00	0.06
181	301006	迈拓股份	5,300	66,515.00	0.05
182	603182	嘉华股份	5,800	66,120.00	0.05
183	301429	森泰股份	4,200	65,814.00	0.05
184	603073	彩蝶实业	4,300	64,113.00	0.05
185	300387	富邦科技	9,400	63,826.00	0.05
186	002817	黄山胶囊	10,800	63,288.00	0.05
187	603029	天鹅股份	4,300	60,458.00	0.05
188	300176	鸿特科技	12,300	59,655.00	0.05
189	300645	正元智慧	4,900	57,673.00	0.05
190	603171	税友股份	500	19,925.00	0.02
191	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
192	600036	招商银行	4	142.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰海通	7,731,485.00	5.31
2	300033	同花顺	5,572,286.00	3.83
3	600030	中信证券	4,219,784.00	2.90
4	002465	海格通信	4,195,483.00	2.88
5	002967	广电计量	4,116,550.00	2.83
6	688107	安路科技	4,101,670.24	2.82
7	000776	广发证券	4,077,991.00	2.80
8	601108	财通证券	3,992,072.00	2.74
9	300059	东方财富	3,685,204.00	2.53
10	300085	银之杰	3,308,483.00	2.27
11	603228	景旺电子	3,277,008.00	2.25
12	600570	恒生电子	2,956,603.00	2.03
13	300553	集智股份	2,954,182.00	2.03
14	601555	东吴证券	2,929,575.00	2.01
15	300476	胜宏科技	2,888,951.00	1.99
16	600958	东方证券	2,608,464.00	1.79
17	601198	东兴证券	2,589,251.00	1.78
18	603977	国泰集团	2,581,960.00	1.77
19	688019	安集科技	2,474,088.41	1.70
20	000733	振华科技	2,430,150.00	1.67

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	5,583,599.32	3.84
2	601138	工业富联	4,882,357.86	3.36
3	600150	中国船舶	4,721,917.45	3.25
4	688107	安路科技	4,434,927.55	3.05
5	300085	银之杰	3,794,812.26	2.61
6	600938	中国海油	3,653,135.00	2.51
7	603228	景旺电子	3,432,391.75	2.36
8	300553	集智股份	3,430,257.50	2.36
9	300760	迈瑞医疗	3,244,440.00	2.23
10	300476	胜宏科技	2,970,781.04	2.04
11	688019	安集科技	2,589,903.00	1.78
12	601555	东吴证券	2,584,222.00	1.78
13	000733	振华科技	2,566,422.24	1.76
14	600941	中国移动	2,389,803.00	1.64
15	000333	美的集团	2,203,878.72	1.51
16	000560	我爱我家	2,202,408.00	1.51
17	002225	濮耐股份	2,159,823.00	1.48
18	000426	兴业银锡	1,949,300.00	1.34
19	688603	天承科技	1,889,165.56	1.30
20	601088	中国神华	1,852,798.00	1.27

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	96,404,491.53
卖出股票收入（成交）总额	108,800,964.54

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，工商银行（601398）的发行主体中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）存在被监管公开处罚的情形。

1、工商银行（601398）

根据 2026 年 6 月 5 日的行政处罚决定，工商银行因：重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等，被国家金融监督管理总局罚款 105 万元。

根据 2025 年 12 月 18 日的行政处罚决定，工商银行因：未经批准办理跨境资产转让业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定进行国际收支统计申报，被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款、没收违法所得，罚没款金额 1142.59 万元。

根据 2025 年 12 月 10 日的行政处罚决定，工商银行因：1. 违反金融统计相关规定；2. 违反账户管理规定；3. 违反清算管理规定；4. 违反特约商户实名制管理规定；5. 违反反假货币业务管理规定；6. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7. 未按规定履行客户身份识别义务；8. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；9. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10. 与身份不明的客户进行交易，被中国人民银行警告；没收违法所得 434.570857 万元；罚款 3961.5 万元。

对工商银行（601398）的投资决策程序的说明：

本基金管理人认为，上述处罚事项未对工商银行的长期经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,925.77
2	应收清算款	603,450.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,426.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	636,802.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,962	53,431.55	29,844.37	0.02	158,234,392.12	99.98

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	98.83

8.3 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	238,918.54	0.15

8.4 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 8 月 27 日） 基金份额总额	1,812,340,657.17
本报告期期初基金份额总额	189,847,978.62
本报告期基金总申购份额	936,926.14
减：本报告期基金总赎回份额	32,520,668.27
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	158,264,236.49

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额；总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
（2）本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人未有受到监管部门调查或处罚的情形。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人相关从业人员未有受到监管部门调查或处罚的情形。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
太平洋证券	1	75,232,175.15	36.66	32,793.08	36.66	-
国联民生证券	2	37,565,214.36	18.31	16,375.48	18.31	-
中邮证券	1	34,012,800.66	16.58	14,825.47	16.58	-
国泰海通证券	2	19,169,681.38	9.34	8,356.51	9.34	-
广发证券	1	12,433,723.48	6.06	5,420.07	6.06	-
天风证券	1	10,799,407.40	5.26	4,707.35	5.26	-
银河证券	2	8,204,011.00	4.00	3,575.64	4.00	-
甬兴证券	1	4,374,781.04	2.13	1,906.93	2.13	-
兴业证券	1	3,403,551.60	1.66	1,483.60	1.66	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

华鑫证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全、在业内有良好的声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 5 日
2	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
3	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
4	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
5	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
6	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	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
7	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年 2 月）	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
8	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
9	诺德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
10	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
11	诺德基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛投资管理有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 8 日
12	诺德基金管理有限公司旗下部分基金	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日

	2026 年第 1 季度报告提示性公告		
13	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日

注：中国证监会规定媒介指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

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

诺德基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日