

# 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| 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.....       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16        |
| 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..... | 16        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 17        |
| 6.2 利润表.....                                 | 18        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 19        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 20        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 41        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 41        |
| 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.....     | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 47        |
| 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.....    | 47        |
| 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..... | 48        |
| 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..... | 48        |
| 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.....    | 48        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 48        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 48        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 49        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 50        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 50        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 50        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>52</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 53        |
| 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.....      | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 53        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 53        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 54        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>58</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....   | 58        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 59        |
| 12.2 存放地点.....           | 59        |
| 12.3 查阅方式.....           | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 诺德成长精选              |                 |
| 场内简称            | -                   |                 |
| 基金主代码           | 003561              |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                 |
| 基金合同生效日         | 2017 年 2 月 24 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      | 525,798,000.06 份    |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 诺德成长精选 A            | 诺德成长精选 C        |
| 下属分级基金场内简称:     | -                   | -               |
| 下属分级基金的交易代码:    | 003561              | 003562          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 485,360,676.18 份    | 40,437,323.88 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，通过深入研究精选具有良好持续成长潜力的上市公司，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金秉承长期投资和价值投资的理念，关注上市公司因成长而具备的价值，强调对行业和公司的基本面进行长期、深入、有前瞻性的研究，精心挑选成长行业中的具有完善的治理结构、核心的竞争力、良好的行业景气度、预期未来两年预期主营业务收入和行业市占率处于行业前列，或具有潜在主营业务收入或公司利润高速增长趋势的成长性优势企业进行长期投资。在充分考虑风险因素的基础上，构建投资组合并进行动态管理。力争在严格控制整体风险的前提下，实现基金的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%  |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置的混合型基金，属于基金中的中等风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。   |

### 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 | 罗丽娟        | 石立平          |

|        |      |                                  |                               |
|--------|------|----------------------------------|-------------------------------|
|        | 联系电话 | 021-68985058                     | 010-63639180                  |
|        | 电子邮箱 | lijuan.luo@nuodefund.com         | shiliping@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  |      | 潘福祥                              | 李晓鹏                           |

## 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》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.nuodefund.com      |
| 基金半年度报告备置地点          | 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                       |
|--------|------------|----------------------------|
| 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

| 基金级别          | 诺德成长精选 A                    | 诺德成长精选 C                    |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 13,994,392.43               | 730,277.37                  |
| 本期利润          | 846,713.17                  | -1,176,285.25               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0029                      | -0.0902                     |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.26%                       | -8.03%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.56%                       | 3.63%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日)            |                             |
| 期末可供分配利润      | 49,581,811.60               | 4,124,691.70                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1022                      | 0.1020                      |
| 期末基金资产净值      | 534,942,487.78              | 44,562,015.58               |
| 期末基金份额净值      | 1.1022                      | 1.1020                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年6月30日)            |                             |
| 基金份额累计净值增长率   | 10.22%                      | 10.20%                      |

注：1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3、 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、 本基金合同生效日为 2017 年 2 月 24 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

诺德成长精选 A

| 阶段 | 份额净值增 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|

|            | 长率①    | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 收益率标准差④ |        |        |
|------------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|
| 过去一个月      | -3.34% | 0.99%   | -4.30% | 0.76%   | 0.96%  | 0.23%  |
| 过去三个月      | -1.17% | 0.71%   | -5.33% | 0.68%   | 4.16%  | 0.03%  |
| 过去六个月      | 3.56%  | 0.75%   | -6.67% | 0.69%   | 10.23% | 0.06%  |
| 过去一年       | 7.25%  | 0.56%   | -1.86% | 0.56%   | 9.11%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 10.22% | 0.49%   | 0.93%  | 0.52%   | 9.29%  | -0.03% |

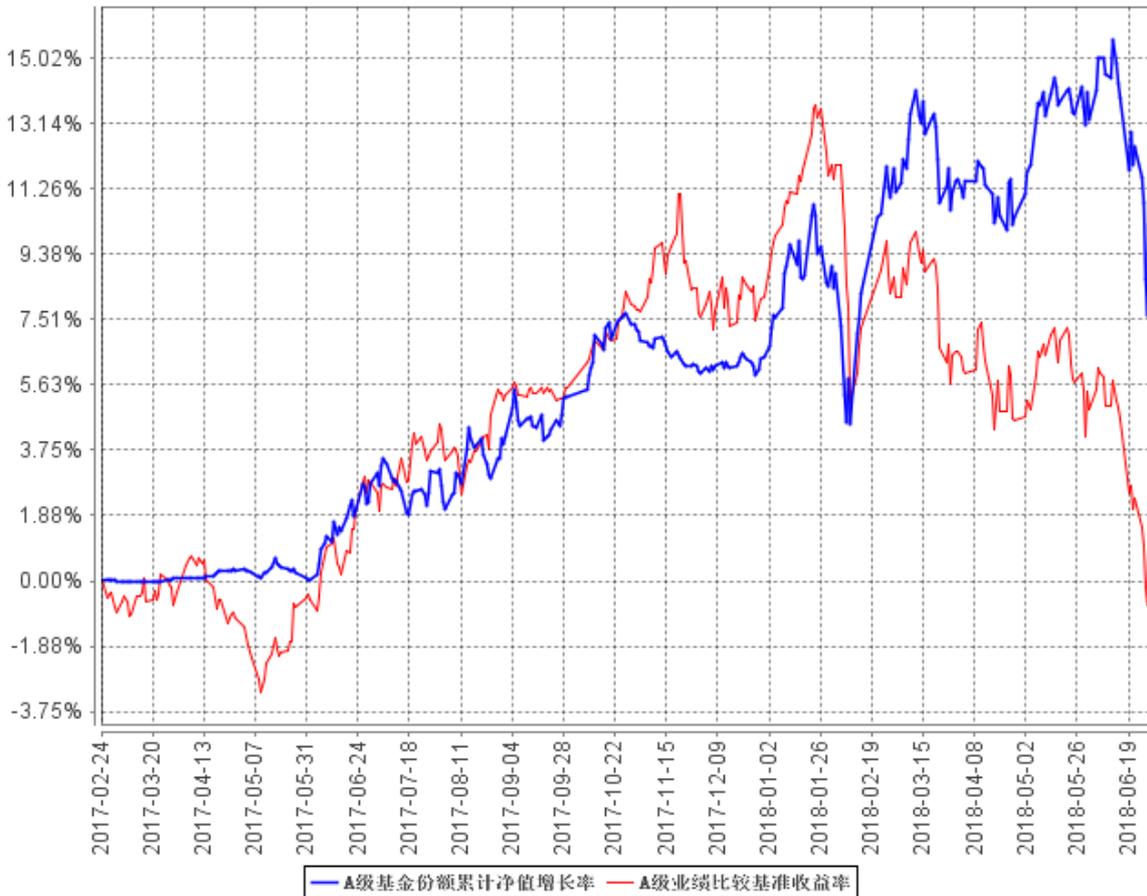
## 诺德成长精选 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -3.35%   | 0.99%       | -4.30%     | 0.76%         | 0.95%  | 0.23%  |
| 过去三个月      | -1.08%   | 0.71%       | -5.33%     | 0.68%         | 4.25%  | 0.03%  |
| 过去六个月      | 3.63%    | 0.75%       | -6.67%     | 0.69%         | 10.30% | 0.06%  |
| 过去一年       | 7.27%    | 0.56%       | -1.86%     | 0.56%         | 9.13%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 10.20%   | 0.49%       | 0.93%      | 0.52%         | 9.27%  | -0.03% |

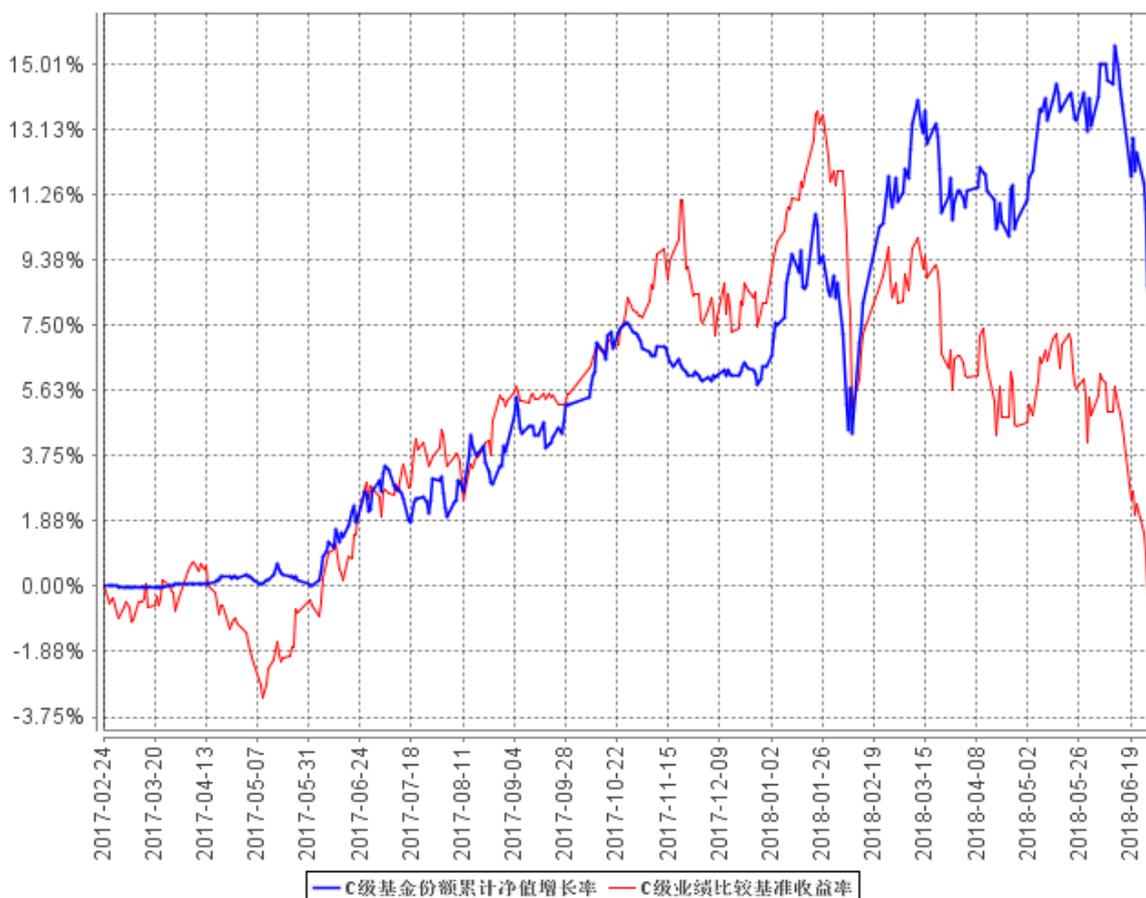
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*60%+中国债券总指数收益率\*40%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同于 2017 年 2 月 24 日生效，图示时间段为 2017 年 2 月 24 日-2018 年 6 月 30 日。本基金建仓期间自 2017 年 2 月 24 日至 2017 年 8 月 23 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。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了十八只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证 300 指数分级证券投资基金、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以及诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                           | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                              | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 郝旭东 | 本基金基金经理以及诺德成长优势混合型证券投资基金基金经理 | 2017 年 2 月 24 日 | -    | 10     | 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。 |

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。

## 4.2 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

2018 年上半年，市场趋势下行，其中，沪深 300 下跌 12.90%，中小板指下跌 14.26%，创业板指下跌 8.33%。上半年市场热点轮转较快，但从二季度开始核心主线集中于医药为代表的泛消费，而中小创为代表的成长题材波段反弹，市场估值水平分化极大。板块方面，休闲服务、医药

生物、食品饮料分别上涨 8.98%、3.11%、0.14%，居涨幅前三，也是全市场仅有的三个上涨板块；同时，跌幅前三的综合、通信、电气设备分别下跌 31.17%、27.14%、24.88%。总的看，上半年市场风险偏好明显降低，基本面弱周期性和确定性是市场关注的核心。

本基金在 2018 年上半年总体仍保持均衡配置、精选个股的总体策略，基金仓位较为灵活，择时进行了仓位调整，较为有效。配置板块上，以业绩确定性强的部分消费作为底仓，对蓝筹、消费、部分成长股进行轮动操作，操作上虽有不足，但整体获得正收益，跑赢业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，诺德成长精选 A 类份额净值为 1.1022 元，累计净值为 1.1022 元。本报告期份额净值增长率为 3.56%，同期业绩比较基准增长率为-6.67%。诺德成长精选 C 类份额净值为 1.1020 元，累计净值为 1.1020 元。本报告期份额净值增长率为 3.63%，同期业绩比较基准增长率为-6.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年 6 月全国制造业 PMI 为 51.5%，较 5 月的 51.9% 小幅回落，其中，6 月新订单指标由 5 月份的 53.8% 回落至 53.2%，有所回落但仍在 50 以上，表明需求略有转弱，但具备一定韧性。6 月新出口订单指标由 5 月份的 51.2% 降至 49.8%，外需明显转弱，成为需求放缓的主要拖累。上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.7%，其中 6 月规模以上工业增加值同比实际增长 6.0%，比 5 月份回落 0.8 个百分点，增长有韧性但压力仍存。6 月新增社融 1.18 万亿元，低于去年同期的 1.77 万亿元；M2 同比增长 8%，增速创历史新低，较 5 月回落 0.3 个百分点，金融监管持续，货币政策微调，从合理稳定到合理宽裕，从降杠杆到稳杠杆。

2018 年上半年，市场下行，以医药、食品饮料为代表的消费类个股表现优秀，这与市场对经济增长放缓预期密切相关，上市公司盈利增长的确性被赋予充分估值溢价。后续投资中，个股的选择将会占有更大权重，而估值和业绩成长的匹配将更加重要，需要考虑一是目前较高估值的医药等弱周期消费股业绩增长兑现程度；二是前期调整幅度较大的与宏观经济密切相关的部分行业龙头，当前的估值水平是否反映了最差预期。

2018 年下半年，本基金仍将坚持均衡配置、精选个股的长期策略，并根据市场情况采取较为灵活的基金仓位。下半年本基金将立足于组合安全性，主要关注 3 个方面投资机会，一是已经调整相对比较充分且行业景气仍能持续的部分白马蓝筹，包括部分金融地产产业链个股；二是有政策支持高速增长的新兴产业，重点是 5G、电子、计算机等；三是医药为代表的消费在可能的调整

后的投资机会。在经历 2018 年上半年的调整行情后，未来市场赚钱效应有所提升，本基金将通过适当仓位管理，精选个股，以期获得相对稳定的投资回报，战胜比较基准。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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成长精选灵活配置混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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，对诺德成长精选灵活配置混合型证券投资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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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——诺德基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支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，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——诺德基金管理有限公司编制的《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、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：诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 252,978,444.98                 | 44,805,086.87                    |
| 结算备付金           |            | 4,112,888.07                   | 3,567,904.39                     |
| 存出保证金           |            | 212,915.40                     | 144,917.32                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 344,315,293.72                 | 11,048,046.15                    |
| 其中：股票投资         |            | 344,315,293.72                 | 11,048,046.15                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 25,157,764.38                    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 52,906.04                      | -1,263.14                        |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,780,604.66                   | 1,889.19                         |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 603,453,052.87                 | 84,724,345.16                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 19,441,763.72                  | -                                |
| 应付赎回款           |            | 3,039,209.26                   | 84,929.33                        |
| 应付管理人报酬         |            | 709,769.87                     | 108,805.59                       |
| 应付托管费           |            | 118,295.00                     | 18,134.23                        |
| 应付销售服务费         |            | 3,760.25                       | 540.78                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 534,049.62                     | 104,434.64                       |

|               |          |                |               |
|---------------|----------|----------------|---------------|
| 应交税费          |          | -              | -             |
| 应付利息          |          | -              | -             |
| 应付利润          |          | -              | -             |
| 递延所得税负债       |          | -              | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 101,701.79     | 320,320.01    |
| 负债合计          |          | 23,948,549.51  | 637,164.58    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 525,798,000.06 | 79,014,826.36 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 53,706,503.30  | 5,072,354.22  |
| 所有者权益合计       |          | 579,504,503.36 | 84,087,180.58 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 603,453,052.87 | 84,724,345.16 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额为 525,798,000.06 份，其中 A 类基金份额总额 485,360,676.18 份，基金份额净值 1.1022 元；C 类基金份额总额 40,437,323.88 份，基金份额净值 1.1020 元。

## 6.2 利润表

会计主体：诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 2 月 24 日(基金<br>合同生效日)至 2017 年 6<br>月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 4,136,143.85                             | 6,173,553.43  |
| 1.利息收入                |            | 1,139,728.25                             | 1,504,819.39  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 633,875.94                               | 915,501.54  |
| 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            |            | 505,852.31                               | 589,317.85  |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 17,765,104.68                            | 1,383,280.64  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 16,382,933.17                            | 1,221,291.51  |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 1,382,171.51                             | 161,989.13  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -15,054,241.88                           | 3,115,834.72  |

|                            |            |              |              |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -            | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.18   | 285,552.80   | 169,618.68   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 4,465,715.93 | 1,512,467.84 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,533,367.16 | 997,667.23   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 422,227.87   | 166,277.85   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 7,036.92     | 17,347.67    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 1,403,906.84 | 200,499.71   |
| 5. 利息支出                    |            | -            | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -            | -            |
| 6. 税金及附加                   |            | -            | -            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 99,177.14    | 130,675.38   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -329,572.08  | 4,661,085.59 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -329,572.08  | 4,661,085.59 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |               |                |
|-----------------------------------|---------------------------------------|---------------|----------------|
|                                   | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 79,014,826.36                         | 5,072,354.22  | 84,087,180.58  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | -329,572.08   | -329,572.08    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 446,783,173.70                        | 48,963,721.16 | 495,746,894.86 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 527,161,430.25                        | 58,225,537.05 | 585,386,967.30 |

|  |   |               |                |
|--|---|---------------|----------------|
| 2. 基金赎回款                               | -80,378,256.55                            | -9,261,815.89 | -89,640,072.44 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -   | -             | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 525,798,000.06                            | 53,706,503.30 | 579,504,503.36 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年2月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |               |                |
|  | 实收基金                                      | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 218,724,167.55                            | -             | 218,724,167.55 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 4,661,085.59  | 4,661,085.59   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -78,369,753.33                            | -778,356.03   | -79,148,109.36 |
| 其中: 1.基金申购款                            | 673,125.37                                | 5,143.46      | 678,268.83     |
| 2.基金赎回款                                | -79,042,878.70                            | -783,499.49   | -79,826,378.19 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -   | -             | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 140,354,414.22                            | 3,882,729.56  | 144,237,143.78 |

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:

\_\_\_\_\_  
潘福祥

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
潘福祥

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
高奇

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2221号《关于准予诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 218,602,060.93 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(2017)第 076 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 218,724,167.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 122,106.62 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《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,投资者可自行选择基金份额类别进行认购/申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货及法律、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:股票投资占基金资产的 0%-95%,权证投资占基金资产净值的 0%-3%,每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中国债券总指数收益率 $\times$ 40%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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行税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2018年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 252,978,444.98    |
| 定期存款         | -                 |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                 |
| 存款期限1-3个月    | -                 |
| 存款期限3个月以上    | -                 |
| 其他存款         | -                 |
| 合计：          | 252,978,444.98    |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2018年6月30日 |                |                |
|-------------------|-------------------|----------------|----------------|
|                   | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票                | 359,337,985.14    | 344,315,293.72 | -15,022,691.42 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 359,337,985.14    | 344,315,293.72 | -15,022,691.42 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 50,956.95         |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 1,850.80          |
| 应收债券利息     | -                 |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | 2.39              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 95.90             |
| 合计         | 52,906.04         |

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 534,049.62        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 534,049.62        |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 2,524.65          |
| 预提费用        | 99,177.14         |
| 合计          | 101,701.79        |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 诺德成长精选 A      |                                       |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 73,013,836.36                         | 73,013,836.36  |
| 本期申购          | 486,724,106.37                        | 486,724,106.37 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -74,377,266.55                        | -74,377,266.55 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -              |
| 本期末           | 485,360,676.18                        | 485,360,676.18 |

金额单位：人民币元

| 诺德成长精选 C      |                                       |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |               |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 6,000,990.00                          | 6,000,990.00  |
| 本期申购          | 40,437,323.88                         | 40,437,323.88 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -6,000,990.00                         | -6,000,990.00 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -             |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -             |
| 本期申购          | -                                     | -             |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -             |
| 本期末           | 40,437,323.88                         | 40,437,323.88 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 诺德成长精选 A |               |                |               |
|----------|---------------|----------------|---------------|
| 项目       | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
| 上年度末     | 5,074,240.11  | -382,062.18    | 4,692,177.93  |
| 本期利润     | 13,994,392.43 | -13,147,679.26 | 846,713.17    |
| 本期基金份额交易 | 40,713,257.20 | 3,329,700.50   | 44,042,957.70 |

|          |               |                |               |
|----------|---------------|----------------|---------------|
| 产生的变动数   |               |                |               |
| 其中：基金申购款 | 48,256,172.66 | 4,365,688.27   | 52,621,860.93 |
| 基金赎回款    | -7,542,915.46 | -1,035,987.77  | -8,578,903.23 |
| 本期已分配利润  | -             | -              | -             |
| 本期末      | 59,781,889.74 | -10,200,040.94 | 49,581,848.80 |

单位：人民币元

| 诺德成长精选 C       |              |               |               |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 411,533.64   | -31,357.35    | 380,176.29    |
| 本期利润           | 730,277.37   | -1,906,562.62 | -1,176,285.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,927,895.04 | 992,868.42    | 4,920,763.46  |
| 其中：基金申购款       | 4,601,869.80 | 1,001,806.32  | 5,603,676.12  |
| 基金赎回款          | -673,974.76  | -8,937.90     | -682,912.66   |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 5,069,706.05 | -945,051.55   | 4,124,654.50  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 605,084.50                 |
| 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 | 21,961.90                  |
| 其他        | 6,829.54                   |
| 合计        | 633,875.94                 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 400,568,672.71             |
| 减：卖出股票成本总额 | 384,185,739.54             |
| 买卖股票差价收入   | 16,382,933.17              |

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,382,171.51               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 1,382,171.51               |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -15,054,241.88             |
| ——股票投资                     | -15,054,241.88             |
| ——债券投资                     | -                          |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——贵金属投资                    | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2. 衍生工具                    | -                          |
| ——权证投资                     | -                          |
| 3. 其他                      | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                          |
| 合计                         | -15,054,241.88             |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 284,559.21                      |
| 基金转换费收入 | 993.59                          |
| 合计      | 285,552.80                      |

注：1. 本基金 A 类基金份额赎回费用在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。针对 A 类基金份额，对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于 30 日（含）但少于 90 日的投资人，赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 90 日（含）但少于 180 日（含）的投资人，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 180 日（含）的投资人，将赎回费总额的 25% 计入基金财产。

2. 本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

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

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,403,906.84                    |
| 银行间市场交易费用 | -                               |
| 合计        | 1,403,906.84                    |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目    | 本期                              |
|-------|---------------------------------|
|       | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 审计费用  | 29,752.78                       |
| 信息披露费 | 69,424.36                       |
| 合计    | 99,177.14                       |

### 6.4.7.21 分部报告

不适用。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                    | 与本基金的关系           |
|--------------------------|-------------------|
| 诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）       | 基金管理人、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、基金销售机构      |
| 清华控股有限公司（“清华控股”）         | 基金管理人的股东          |
| 宜信惠民投资管理（北京）有限公司（“宜信惠民”） | 基金管理人的股东          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>2017年2月24日(基金合同生效日)至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,533,367.16               | 997,667.23                                |

|                 |              |            |
|-----------------|--------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,112,790.50 | 326,224.21 |
|-----------------|--------------|------------|

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 2 月 24 日 (基金合同生效日)<br>至 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 422,227.87                            | 166,277.85  |

注：支付基金托管人光大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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日                  |           |           |
|----------------|--|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |           |           |
|                | 诺德成长精选 A   | 诺德成长精选 C  | 合计        |
| 中国光大银行         | -  | 1,786.90  | 1,786.90  |
| 诺德基金           | -  | 5,250.02  | 5,250.02  |
| 合计             | -  | 7,036.92  | 7,036.92  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017 年 2 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |           |           |
|                | 诺德成长精选 A   | 诺德成长精选 C  | 合计        |
| 中国光大银行         | -  | 7,284.47  | 7,284.47  |
| 诺德基金           | -  | 10,063.13 | 10,063.13 |
| 合计             | -  | 17,347.60 | 17,347.60 |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给诺德基金，再由诺德基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率为 0.10%。其计算公式

式为：

日基金销售服务费=前一日 C 类基金份额的资产净值 X 约定年费率/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |              |
|---------------------------------|---------------------------------------|--------------|
|                                 | 诺德成长精选 A                              | 诺德成长精选 C     |
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 24 日）持有的基金份额 | -                                     | 0.00         |
| 期初持有的基金份额                       | -                                     | 0.00         |
| 期间申购/买入总份额                      | -                                     | 4,484,397.42 |
| 期间因拆分变动份额                       | -                                     | -            |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -                                     | -            |
| 期末持有的基金份额                       | -                                     | 4,484,397.42 |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例           | -                                     | 0.85%        |

| 项目                              | 上年度可比期间<br>2017 年 2 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日 |          |
|---------------------------------|--|----------|
|                                 | 诺德成长精选 A   | 诺德成长精选 C |
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 24 日）持有的基金份额 | -  | -        |
| 期初持有的基金份额                       | -  | -        |
| 期间申购/买入总份额                      | -  | -        |
| 期间因拆分变动份额                       | -  | -        |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -  | -        |
| 期末持有的基金份额                       | -  | -        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例           | -  | -        |

注：基金管理人诺德基金管理有限公司本年度申购本基金的交易委托诺德基金直销柜台办理，无

申购费。

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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2017年2月24日(基金合同生效日)至<br>2017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 | 252,978,444.98             | 605,084.50 | 9,807,254.34                                  | 184,784.19 |

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 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（2018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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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 | 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 |
|------|------|------|------|-------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|-------|------|--------|-------|--------|--------|----|

|        |          |                    |                | 价     |                    |       |     |          |          |   |
|--------|----------|--------------------|----------------|-------|--------------------|-------|-----|----------|----------|---|
| 000796 | 凯撒<br>旅游 | 2018<br>年1月<br>19日 | 重大<br>资产<br>重组 | 12.90 | 2018<br>年7月<br>19日 | 11.61 | 100 | 1,337.95 | 1,290.00 | - |

注：本基金截至 2018 年 6 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人创造风险收益比合理、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、稽核风控部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，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 2018 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。（2017 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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，其余均能及时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

### 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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018年6月30日 | 1个月以内          | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|-------------------|----------------|-------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                |                |       |        |      |      |                |                |
| 银行存款              | 252,978,444.98 | -     | -      | -    | -    | -              | 252,978,444.98 |
| 结算备付金             | 4,112,888.07   | -     | -      | -    | -    | -              | 4,112,888.07   |
| 存出保证金             | 212,915.40     | -     | -      | -    | -    | -              | 212,915.40     |
| 交易性金融资产           | -              | -     | -      | -    | -    | 344,315,293.72 | 344,315,293.72 |
| 应收利息              | -              | -     | -      | -    | -    | 52,906.04      | 52,906.04      |
| 应收申购款             | -              | -     | -      | -    | -    | 1,780,604.66   | 1,780,604.66   |
| 资产总计              | 257,304,248.45 | -     | -      | -    | -    | 346,148,804.42 | 603,453,052.87 |
| 负债                |                |       |        |      |      |                |                |

|                          |                |        |          |       |       |                 |                |
|--------------------------|----------------|--------|----------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 应付证券清算款                  |                |        |          |       |       | 19,441,763.72   | 19,441,763.72  |
| 应付赎回款                    |                |        |          |       |       | 3,039,209.26    | 3,039,209.26   |
| 应付管理人报酬                  |                |        |          |       |       | 709,769.87      | 709,769.87     |
| 应付托管费                    |                |        |          |       |       | 118,295.00      | 118,295.00     |
| 应付销售服务费                  |                |        |          |       |       | 3,760.25        | 3,760.25       |
| 应付交易费用                   |                |        |          |       |       | 534,049.62      | 534,049.62     |
| 其他负债                     |                |        |          |       |       | 101,701.79      | 101,701.79     |
| 负债总计                     |                |        |          |       |       | 23,948,549.51   | 23,948,549.51  |
| 利率敏感度缺口                  | 257,304,248.45 |        |          |       |       | -322,200,254.91 | 579,504,503.36 |
| 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息             | 合计             |
| 资产                       |                |        |          |       |       |                 |                |
| 银行存款                     | 44,805,086.87  |        |          |       |       |                 | 44,805,086.87  |
| 结算备付金                    | 3,567,904.39   |        |          |       |       |                 | 3,567,904.39   |
| 存出保证金                    | 144,917.32     |        |          |       |       |                 | 144,917.32     |
| 交易性金融资产                  |                |        |          |       |       | 11,048,046.15   | 11,048,046.15  |
| 应收证券清算款                  |                |        |          |       |       | 25,157,764.38   | 25,157,764.38  |
| 应收利息                     |                |        |          |       |       | -1,263.14       | -1,263.14      |
| 应收申购款                    |                |        |          |       |       | 1,889.19        | 1,889.19       |
| 资产总计                     | 48,517,908.58  |        |          |       |       | 36,206,436.58   | 84,724,345.16  |
| 负债                       |                |        |          |       |       |                 |                |
| 应付赎回款                    |                |        |          |       |       | 84,929.33       | 84,929.33      |
| 应付管理人报酬                  |                |        |          |       |       | 108,805.59      | 108,805.59     |
| 应付托管费                    |                |        |          |       |       | 18,134.23       | 18,134.23      |
| 应付销售服务费                  |                |        |          |       |       | 540.78          | 540.78         |
| 应付交易费用                   |                |        |          |       |       | 104,434.64      | 104,434.64     |
| 其他负债                     |                |        |          |       |       | 320,320.01      | 320,320.01     |
| 负债总计                     |                |        |          |       |       | 637,164.58      | 637,164.58     |
| 利率敏感度缺口                  | 48,517,908.58  |        |          |       |       | -35,569,272.00  | 84,087,180.58  |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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%。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<br>2018 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 344,315,293.72         | 59.42                    | 11,048,046.15            | 13.14                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 其他            | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 合计            | 344,315,293.72         | 59.42                    | 11,048,046.15            | 13.14                 |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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（2018年6月30日） | 上年度末（2017年12月31日） |
|  | 沪深300指数上升5% | 13,717,631.65   | 0.00              |
|  | 沪深300指数下降5% | -13,717,631.65  | 0.00              |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 344,315,293.72 | 57.06         |
|    | 其中：股票             | 344,315,293.72 | 57.06         |
| 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      | 257,091,333.05 | 42.60         |
| 8  | 其他各项资产            | 2,046,426.10   | 0.34          |
| 9  | 合计                | 603,453,052.87 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值 (元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 220,692,123.88 | 38.08         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -             |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 35,682,687.90  | 6.16          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | 2,661,844.90   | 0.46          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,889,918.00   | 1.71          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业           | 29,012,730.64  | 5.01  |
| K | 房地产业          | 42,946,659.20  | 7.41  |
| L | 租赁和商务服务业      | 3,290,029.20   | 0.57  |
| M | 科学研究和技术服务业    | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 139,300.00     | 0.02  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 344,315,293.72 | 59.42 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600048 | 保利地产 | 2,120,812 | 25,873,906.40 | 4.46         |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 1,138,441 | 25,671,844.55 | 4.43         |
| 3  | 002456 | 欧菲科技 | 1,363,792 | 21,997,964.96 | 3.80         |
| 4  | 002035 | 华帝股份 | 858,127   | 20,964,042.61 | 3.62         |
| 5  | 600690 | 青岛海尔 | 1,016,700 | 19,581,642.00 | 3.38         |
| 6  | 601336 | 新华保险 | 357,883   | 15,346,023.04 | 2.65         |
| 7  | 002262 | 恩华药业 | 740,300   | 14,813,403.00 | 2.56         |
| 8  | 000568 | 泸州老窖 | 229,408   | 13,961,770.88 | 2.41         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 429,096   | 13,666,707.60 | 2.36         |
| 10 | 603368 | 柳药股份 | 359,948   | 12,159,043.44 | 2.10         |
| 11 | 600329 | 中新药业 | 604,626   | 11,487,894.00 | 1.98         |
| 12 | 000002 | 万科 A | 460,753   | 11,334,523.80 | 1.96         |
| 13 | 002415 | 海康威视 | 302,300   | 11,224,399.00 | 1.94         |
| 14 | 000858 | 五粮液  | 137,260   | 10,431,760.00 | 1.80         |
| 15 | 000799 | 酒鬼酒  | 356,600   | 9,895,650.00  | 1.71         |
| 16 | 600998 | 九州通  | 578,210   | 9,806,441.60  | 1.69         |
| 17 | 300618 | 寒锐钴业 | 71,600    | 9,189,144.00  | 1.59         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 18 | 002462 | 嘉事堂  | 425,200 | 8,248,880.00 | 1.42 |
| 19 | 300463 | 迈克生物 | 272,900 | 6,803,397.00 | 1.17 |
| 20 | 600867 | 通化东宝 | 279,729 | 6,705,104.13 | 1.16 |
| 21 | 600498 | 烽火通信 | 258,100 | 6,413,785.00 | 1.11 |
| 22 | 603898 | 好莱客  | 230,201 | 6,040,474.24 | 1.04 |
| 23 | 002146 | 荣盛发展 | 657,300 | 5,738,229.00 | 0.99 |
| 24 | 600809 | 山西汾酒 | 87,249  | 5,487,089.61 | 0.95 |
| 25 | 002304 | 洋河股份 | 39,949  | 5,257,288.40 | 0.91 |
| 26 | 000661 | 长春高新 | 19,700  | 4,485,690.00 | 0.77 |
| 27 | 300271 | 华宇软件 | 238,000 | 4,207,840.00 | 0.73 |
| 28 | 600511 | 国药股份 | 152,900 | 4,120,655.00 | 0.71 |
| 29 | 300059 | 东方财富 | 251,700 | 3,317,406.00 | 0.57 |
| 30 | 002707 | 众信旅游 | 342,577 | 3,288,739.20 | 0.57 |
| 31 | 603799 | 华友钴业 | 29,600  | 2,885,112.00 | 0.50 |
| 32 | 002008 | 大族激光 | 50,800  | 2,702,052.00 | 0.47 |
| 33 | 600258 | 首旅酒店 | 97,970  | 2,661,844.90 | 0.46 |
| 34 | 300296 | 利亚德  | 189,300 | 2,438,184.00 | 0.42 |
| 35 | 300294 | 博雅生物 | 61,750  | 1,913,632.50 | 0.33 |
| 36 | 002439 | 启明星辰 | 86,600  | 1,837,652.00 | 0.32 |
| 37 | 603108 | 润达医疗 | 120,113 | 1,347,667.86 | 0.23 |
| 38 | 002384 | 东山精密 | 14,200  | 340,800.00   | 0.06 |
| 39 | 300036 | 超图软件 | 14,000  | 285,460.00   | 0.05 |
| 40 | 300188 | 美亚柏科 | 13,200  | 241,560.00   | 0.04 |
| 41 | 300070 | 碧水源  | 10,000  | 139,300.00   | 0.02 |
| 42 | 000796 | 凯撒旅游 | 100     | 1,290.00     | 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  | 600048 | 保利地产 | 43,034,035.48 | 51.18          |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 32,934,749.43 | 39.17          |
| 3  | 002456 | 欧菲科技 | 32,111,765.20 | 38.19          |
| 4  | 002035 | 华帝股份 | 28,911,293.52 | 34.38          |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 24,124,229.33 | 28.69          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 6  | 600690 | 青岛海尔 | 23,975,495.01 | 28.51 |
| 7  | 601336 | 新华保险 | 23,538,152.60 | 27.99 |
| 8  | 600867 | 通化东宝 | 19,657,795.71 | 23.38 |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 19,553,145.42 | 23.25 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 18,265,094.70 | 21.72 |
| 11 | 002146 | 荣盛发展 | 17,529,653.00 | 20.85 |
| 12 | 600436 | 片仔癀  | 16,544,124.30 | 19.67 |
| 13 | 002304 | 洋河股份 | 16,367,996.00 | 19.47 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 15,838,679.00 | 18.84 |
| 15 | 600329 | 中新药业 | 14,694,648.25 | 17.48 |
| 16 | 002262 | 恩华药业 | 14,598,332.00 | 17.36 |
| 17 | 603368 | 柳药股份 | 14,071,925.48 | 16.73 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 14,048,746.00 | 16.71 |
| 19 | 000002 | 万科A  | 12,764,279.87 | 15.18 |
| 20 | 000799 | 酒鬼酒  | 12,547,430.97 | 14.92 |
| 21 | 603799 | 华友钴业 | 11,522,442.00 | 13.70 |
| 22 | 002460 | 赣锋锂业 | 11,431,150.37 | 13.59 |
| 23 | 600138 | 中青旅  | 11,323,256.70 | 13.47 |
| 24 | 002415 | 海康威视 | 11,309,722.00 | 13.45 |
| 25 | 600466 | 蓝光发展 | 10,980,683.46 | 13.06 |
| 26 | 600998 | 九州通  | 10,726,944.30 | 12.76 |
| 27 | 600887 | 伊利股份 | 10,040,487.14 | 11.94 |
| 28 | 002008 | 大族激光 | 9,885,727.84  | 11.76 |
| 29 | 603898 | 好莱客  | 9,064,604.20  | 10.78 |
| 30 | 002462 | 嘉事堂  | 8,904,064.14  | 10.59 |
| 31 | 300070 | 碧水源  | 8,775,339.00  | 10.44 |
| 32 | 603027 | 千禾味业 | 8,749,875.50  | 10.41 |
| 33 | 300618 | 寒锐钴业 | 8,621,423.60  | 10.25 |
| 34 | 600809 | 山西汾酒 | 8,507,028.75  | 10.12 |
| 35 | 603108 | 润达医疗 | 7,776,216.54  | 9.25  |
| 36 | 300232 | 洲明科技 | 7,575,079.08  | 9.01  |
| 37 | 000963 | 华东医药 | 7,541,571.00  | 8.97  |
| 38 | 300463 | 迈克生物 | 7,078,761.00  | 8.42  |
| 39 | 600498 | 烽火通信 | 6,957,633.98  | 8.27  |
| 40 | 300059 | 东方财富 | 6,940,377.20  | 8.25  |
| 41 | 600703 | 三安光电 | 6,521,184.00  | 7.76  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 42 | 300316 | 晶盛机电 | 6,306,197.85 | 7.50 |
| 43 | 600383 | 金地集团 | 6,021,170.00 | 7.16 |
| 44 | 300365 | 恒华科技 | 5,558,434.56 | 6.61 |
| 45 | 002773 | 康弘药业 | 5,178,136.00 | 6.16 |
| 46 | 002271 | 东方雨虹 | 5,010,811.00 | 5.96 |
| 47 | 600340 | 华夏幸福 | 4,920,218.00 | 5.85 |
| 48 | 002707 | 众信旅游 | 4,898,781.25 | 5.83 |
| 49 | 600258 | 首旅酒店 | 4,727,082.49 | 5.62 |
| 50 | 600487 | 亨通光电 | 4,694,245.00 | 5.58 |
| 51 | 002475 | 立讯精密 | 4,613,214.18 | 5.49 |
| 52 | 600066 | 宇通客车 | 4,583,167.00 | 5.45 |
| 53 | 300115 | 长盈精密 | 4,474,017.94 | 5.32 |
| 54 | 600511 | 国药股份 | 4,466,200.00 | 5.31 |
| 55 | 300271 | 华宇软件 | 4,447,501.00 | 5.29 |
| 56 | 601398 | 工商银行 | 3,651,144.00 | 4.34 |
| 57 | 601288 | 农业银行 | 3,647,862.00 | 4.34 |
| 58 | 600479 | 千金药业 | 3,381,849.00 | 4.02 |
| 59 | 002241 | 歌尔股份 | 3,333,823.00 | 3.96 |
| 60 | 601155 | 新城控股 | 3,158,425.00 | 3.76 |
| 61 | 300199 | 翰宇药业 | 3,114,019.00 | 3.70 |
| 62 | 002332 | 仙琚制药 | 2,776,217.00 | 3.30 |
| 63 | 603986 | 兆易创新 | 2,547,093.00 | 3.03 |
| 64 | 300296 | 利亚德  | 2,419,553.00 | 2.88 |
| 65 | 002812 | 创新股份 | 2,403,334.00 | 2.86 |
| 66 | 000333 | 美的集团 | 2,200,760.00 | 2.62 |
| 67 | 300294 | 博雅生物 | 2,140,810.00 | 2.55 |
| 68 | 300433 | 蓝思科技 | 2,028,971.00 | 2.41 |
| 69 | 002439 | 启明星辰 | 1,732,032.00 | 2.06 |

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  | 600436 | 片仔癀  | 21,233,814.77 | 25.25          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 16,392,998.50 | 19.50 |
| 3  | 600048 | 保利地产 | 15,042,285.88 | 17.89 |
| 4  | 600867 | 通化东宝 | 14,292,072.21 | 17.00 |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 14,209,319.61 | 16.90 |
| 6  | 002460 | 赣锋锂业 | 13,975,374.65 | 16.62 |
| 7  | 002304 | 洋河股份 | 13,465,904.32 | 16.01 |
| 8  | 002146 | 荣盛发展 | 11,538,704.31 | 13.72 |
| 9  | 600466 | 蓝光发展 | 11,217,265.41 | 13.34 |
| 10 | 603799 | 华友钴业 | 10,946,697.55 | 13.02 |
| 11 | 002236 | 大华股份 | 10,884,023.35 | 12.94 |
| 12 | 600138 | 中青旅  | 10,876,664.88 | 12.93 |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 10,245,698.18 | 12.18 |
| 14 | 000963 | 华东医药 | 9,706,530.18  | 11.54 |
| 15 | 002456 | 欧菲科技 | 9,482,322.64  | 11.28 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 9,456,404.95  | 11.25 |
| 17 | 300070 | 碧水源  | 8,367,890.00  | 9.95  |
| 18 | 603027 | 千禾味业 | 8,282,662.45  | 9.85  |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 8,186,175.45  | 9.74  |
| 20 | 002008 | 大族激光 | 7,525,873.50  | 8.95  |
| 21 | 601336 | 新华保险 | 7,281,991.66  | 8.66  |
| 22 | 600703 | 三安光电 | 6,787,184.96  | 8.07  |
| 23 | 300316 | 晶盛机电 | 6,677,329.72  | 7.94  |
| 24 | 603108 | 润达医疗 | 6,184,044.05  | 7.35  |
| 25 | 002773 | 康弘药业 | 5,800,808.00  | 6.90  |
| 26 | 300232 | 洲明科技 | 5,564,617.22  | 6.62  |
| 27 | 300365 | 恒华科技 | 5,231,547.50  | 6.22  |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 5,098,921.40  | 6.06  |
| 29 | 600329 | 中新药业 | 5,017,875.90  | 5.97  |
| 30 | 002271 | 东方雨虹 | 4,928,623.68  | 5.86  |
| 31 | 002475 | 立讯精密 | 4,756,382.19  | 5.66  |
| 32 | 601601 | 中国太保 | 4,672,922.84  | 5.56  |
| 33 | 300115 | 长盈精密 | 4,528,511.00  | 5.39  |
| 34 | 600487 | 亨通光电 | 4,480,861.20  | 5.33  |
| 35 | 600066 | 宇通客车 | 4,421,568.30  | 5.26  |
| 36 | 002035 | 华帝股份 | 4,226,225.85  | 5.03  |
| 37 | 601398 | 工商银行 | 4,070,439.46  | 4.84  |
| 38 | 601288 | 农业银行 | 4,046,063.90  | 4.81  |
| 39 | 600690 | 青岛海尔 | 3,919,654.00  | 4.66  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 40 | 300059 | 东方财富 | 3,773,385.90 | 4.49 |
| 41 | 000568 | 泸州老窖 | 3,511,094.40 | 4.18 |
| 42 | 002241 | 歌尔股份 | 3,191,289.60 | 3.80 |
| 43 | 300199 | 翰宇药业 | 3,186,989.86 | 3.79 |
| 44 | 600479 | 千金药业 | 3,162,496.71 | 3.76 |
| 45 | 601155 | 新城控股 | 2,934,189.50 | 3.49 |
| 46 | 600258 | 首旅酒店 | 2,882,585.00 | 3.43 |
| 47 | 600809 | 山西汾酒 | 2,882,090.45 | 3.43 |
| 48 | 603986 | 兆易创新 | 2,766,223.00 | 3.29 |
| 49 | 002812 | 创新股份 | 2,598,557.00 | 3.09 |
| 50 | 000799 | 酒鬼酒  | 2,536,580.00 | 3.02 |
| 51 | 002332 | 仙琚制药 | 2,507,273.70 | 2.98 |
| 52 | 000333 | 美的集团 | 2,181,751.30 | 2.59 |
| 53 | 603898 | 好莱客  | 2,043,978.00 | 2.43 |
| 54 | 300433 | 蓝思科技 | 1,846,254.10 | 2.20 |
| 55 | 600211 | 西藏药业 | 1,820,153.00 | 2.16 |
| 56 | 600566 | 济川药业 | 1,747,474.00 | 2.08 |
| 57 | 600872 | 中炬高新 | 1,716,848.31 | 2.04 |

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 | 732,507,228.99 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 400,568,672.71 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

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   | 212,915.40   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 52,906.04    |
| 5  | 应收申购款   | 1,780,604.66 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,046,426.10 |

### 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

| 份额级别     | 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 |
| 诺德成长精选 A | 10,327   | 46,999.19     | 159,698,624.08 | 32.90%  | 325,662,052.10 | 67.10% |
| 诺德成长精选 C | 4        | 10,109,330.97 | 40,437,323.88  | 100.00% | -              | -      |
| 合计       | 10,331   | 50,895.17     | 200,135,947.96 | 38.06%  | 325,662,052.10 | 61.94% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 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 | 诺德成长精选 A | 476,455.37 | 0.10%    |
|                  | 诺德成长精选 C | -          | -        |
|                  | 合计       | 476,455.37 | 0.09%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别     | 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 | 诺德成长精选 A | 0                 |
|                                | 诺德成长精选 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 诺德成长精选 A | 0                 |
|                                | 诺德成长精选 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 诺德成长精选 A       | 诺德成长精选 C      |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 24 日）基金份额总额 | 167,705,302.55 | 51,018,865.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 73,013,836.36  | 6,000,990.00  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 486,724,106.37 | 40,437,323.88 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 74,377,266.55  | 6,000,990.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -             |
| 本报告期末基金份额总额                    | 485,360,676.18 | 40,437,323.88 |

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2018 年 5 月 7 日，中国光大银行股份有限公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务。

### 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 2018 年度的基金审计机构。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 2 年的审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 |
|------|------|-----------|
|      |      |           |

|       | 交易单元<br>数量 | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 备注 |
|-------|------------|----------------|----------------------|------------|----------------|----|
| 华鑫证券  | 2          | 548,127,605.24 | 48.38%               | 400,846.69 | 44.40%         | -  |
| 太平洋证券 | 1          | 371,033,591.31 | 32.75%               | 345,542.97 | 38.27%         | -  |
| 财达证券  | 2          | 213,914,705.15 | 18.88%               | 156,436.04 | 17.33%         | -  |

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、安全通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：无，退租交易单元：无。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易 |                      | 债券回购交易           |                            | 权证交易 |                          |
|-------|------|----------------------|------------------|----------------------------|------|--------------------------|
|       | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额             | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额<br>的比例 |
| 华鑫证券  | -    | -                    | 1,280,000,000.00 | 60.63%                     | -    | -                        |
| 太平洋证券 | -    | -                    | 831,000,000.00   | 39.37%                     | -    | -                        |
| 财达证券  | -    | -                    | -                | -                          | -    | -                        |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项         | 法定披露方式    | 法定披露日期    |
|----|--------------|-----------|-----------|
| 1  | 诺德基金管理有限公司旗下 | 上海证券报、中国证 | 2018年1月2日 |

|    |   |                       |                 |
|----|---|-----------------------|-----------------|
|    | 基金资产净值与份额净值公告   | 券报、证券时报、公司网站          |                 |
| 2  | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告                                  | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 1 月 22 日 |
| 3  | 诺德基金管理有限公司关于深圳市小牛投资咨询有限公司开通诺德基金旗下部分基金定投业务的公告                        | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 1 月 25 日 |
| 4  | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国都证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                           | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 1 月 27 日 |
| 5  | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告                  | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 1 月 29 日 |
| 6  | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国光大银行股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告                | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 7 日  |
| 7  | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告                                     | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 24 日 |
| 8  | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 24 日 |
| 9  | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 24 日 |
| 10 | 诺德基金管理有限公司关于新增东海证券股份有限公司为旗下诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 28 日 |
| 11 | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告                                      | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 29 日 |
| 12 | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要                                    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 29 日 |
| 13 | 诺德基金管理有限公司关于  | 上海证券报、中国证             | 2018 年 3 月 31 日 |

|    |  |                       |                 |
|----|--|-----------------------|-----------------|
|    | 旗下部分基金参加东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告  | 券报、证券时报、公司网站          |                 |
| 14 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告                           | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 3 日  |
| 15 | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 11 日 |
| 16 | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 11 日 |
| 17 | 诺德基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 12 日 |
| 18 | 诺德基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告                      | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 17 日 |
| 19 | 诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 21 日 |
| 20 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告                             | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 25 日 |
| 21 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告                             | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 5 月 19 日 |
| 22 | 关于诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入业务的公告  | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018 年 6 月 13 日 |
| 23 | 诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持“中兴通讯”   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公    | 2018 年 6 月 13 日 |

|    |   |                       |            |
|----|---|-----------------------|------------|
|    | 股票估值方法调整的公告   | 司网站                   |            |
| 24 | 诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018年6月16日 |
| 25 | 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               | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018年6月16日 |
| 26 | 诺德基金管理有限公司关于新增中信银行股份有限公司为旗下诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018年6月16日 |
| 27 | 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               | 上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站 | 2018年6月29日 |

## § 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、《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告原文。
- 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 / 或基金托管人的办公场所，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

2018 年 8 月 27 日