

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型
基金中基金（FOF）
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§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	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 本报告期投资基金情况.....	39
7.13 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件.....	46
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46

10.9 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）
基金简称	诺德大类精选（FOF）
基金主代码	008079
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 9 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	415,354,255.96 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	30,362,465.14
本期利润	9,275,030.93
加权平均基金份额本期利润	0.0200
本期加权平均净值利润率	1.45%
本期基金份额净值增长率	2.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	120,217,997.04
期末可供分配基金份额利润	0.2894
期末基金资产净值	587,849,106.99
期末基金份额净值	1.4153
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	41.53%

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2019年12月9日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

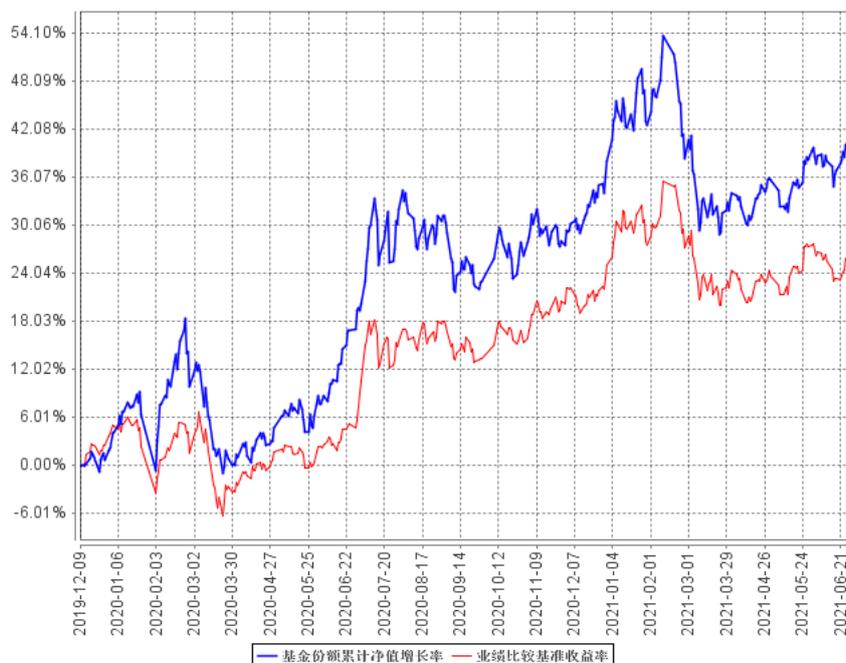
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.62%	0.79%	-1.54%	0.60%	3.16%	0.19%
过去三个月	7.31%	0.79%	2.77%	0.73%	4.54%	0.06%
过去六个月	2.51%	1.20%	0.43%	0.99%	2.08%	0.21%
过去一年	18.68%	1.22%	18.82%	1.00%	-0.14%	0.22%
自基金合同	41.53%	1.29%	25.57%	1.02%	15.96%	0.27%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2019 年 12 月 9 日，图示时间段为 2019 年 12 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日。

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

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了三十二只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑源	本基金基金经理、FOF 管理部投资总监、深圳分公司总经理	2019 年 12 月 9 日	-	12	香港理工大学计算机博士。曾任中国银河证券股份有限公司高级研究员、民生证券股份有限公司资深研究员、华泰联合证券有限责任公司资深研究员、中国创新投资有限公司（香港）投资经理、高扬集团有限公司（香港）投资经理。2017 年 1 月加

					入诺德基金管理有限公司，现任 FOF 管理部投资总监、深圳分公司总经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日；除首任基金经理外，“任职日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期；“离任日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 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

在过去的 2021 年上半年中，我们在管理本基金时，将工作重点集中于产品的风险控制。我们

延续了从 1 季度开始的基金产品风险识别工作。我们对于基金产品进行了更加全面、更加细腻、更加精准的风险分析。在此风险分析的基础上，我们重构了整个产品的风险管理体系。我们希望通过全新的风险管理体系，有效降低产品的波动和净值回撤。基于升级后的风险管理体系，我们对持仓的基金产品及其权重均进行了相应的调整。这一调整在 5 月中旬之前已基本完成。从过去约 3 个月的产品表现来看，我们认为调整基本达到预期效果。

在基于风险管理体系进行持仓调整的同时，我们也将对于资产类别的判断融入到了持仓组合中。除了我们长期看好的科技、医药和消费等三个赛道外，我们还维持了 1 季度纳入组合的偏周期标的。另外，根据我们对于基金经理的大量调研，以及结合宏观经济和中观行业景气度的跟踪，我们增加了半导体、新能源汽车以及光伏等细分行业的标的比重，而降低了部分银行、房地产和保险等大金融板块的投资比例。从持仓结构的整体变化来看，我们认为产品持仓变得更为均衡和分散。但对于取得市场广泛认同的景气板块，我们进行了一定的配置比例提升。因此，产品可以通过更加平稳的方式，获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4153 元，累计净值为 1.4153 元。本报告期份额净值增长率为 2.51%，同期业绩比较基准增长率为 0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断 2021 年下半年，中国的宏观经济整体仍将处于典型的产能周期增速缓慢回落，与库存周期中主动补库存相叠加的经济阶段。简单来说，宏观经济正处于中周期回落和短周期上升的阶段。从过去 20 年的权益市场运行规律看来，在这样的经济周期阶段下，权益市场的风格仍将为成长风格主导。同时，不少中游板块也将会有绝对收益的机会。从 6 月份以来披露的各项最新经济数据来看，整个国家的经济生产恢复良好，短周期经济上行动能仍然强劲。但是，总需求的动能可能有所减弱，我们相信下半年政策对于经济动能减缓的对冲调控可能会明显增强。对于宏观经济的正向刺激可能会超预期。同时，结合上半年的宏观调控力度来看，全年宏观经济动能或可维持较高的水平。从资金成本的角度来看，由于下半年政策调控可能加码，专项债的发行会进一步加快，这将导致资金需求强劲，因此，资金成本可能会有上升的压力。但 7 月份，央行进行了超市场预期的“降准”，这对资金成本的上升形成较好的压制，我们考虑下半年央行可能再进行“降准”，甚至可能进行“降息”。这对资金成本回落起到较为明显的促进作用。总体看来，我们认为宏观经济场景可能逐渐转变为是动能趋缓与资金成本回落的宏观经济场景，权益市场仍可能维持震荡上行的走势。相较债券而言，权益类资产仍然具有较高的性价比优势，但优势幅度可

能下降，因此，我们仍会将权益类资产作为重点投资方向，但会对债券类品种进行重点跟踪和观察，不排除择机少量配置的可能性。

从行业板块的景气特征和对基金经理的调研反馈来看，我们相信下半年表现最好的行业板块可能是新能源车。从政策层面来看，全球各大主要经济体，包括美国、欧盟和中国都推出了超预期相关刺激政策。从渗透率的变化来看，全球新能源车的销售量正在迅速提升，但空间仍然十分巨大。从技术层面的突破来看，不论是快充型的大容量电池，还是从液态向固态电池的技术发展，都在高速升级中。从市场的一致预期来看，该行业每年保守估计的增量应该在 30%左右。因此，整个产业链，从上游的电极材料、电解液、隔膜，到电池生产、整车生产装配，再到下游的相关传统零配件，以及汽车电子等，都将呈现出较高的景气度。

另外，上游资源行业，仍可能因为“碳达峰”对产能的限制和年内维持“泛滥”的全球流动性，保持较高的景气程度。从市场的一致预期来看，PPI 在年内仍可能维持较高的水平。同时，由于受到环境政策的影响，产能短期内难以迅速提升。因此，我们相信上游资源的供应紧张仍会维持，价格难以大幅下行。最后，我们仍然看好科技，医药，和消费三个行业，虽然，短期内这三个行业的估值可能由于资金成本上升而受到压制，但长期来看仍是高质量的赛道，值得长期持有。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	67,980,984.98	45,466,305.21
结算备付金		6,522,647.72	319,648.16
存出保证金		768,902.97	507,734.41
交易性金融资产	6.4.7.2	534,961,182.67	504,288,757.04
其中：股票投资		-	-
基金投资		534,961,182.67	504,288,757.04
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		35,235,172.99	20,901,789.34
应收利息	6.4.7.5	25,294.05	19,464.29
应收股利		-	-
应收申购款		468,306.47	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		645,962,491.85	571,503,698.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		17,769,229.69	1,136,203.19
应付赎回款		39,020,923.08	-
应付管理人报酬		528,877.77	460,058.92
应付托管费		52,887.77	46,005.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	647,247.00	49,265.90
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	94,219.55	178,766.11
负债合计		58,113,384.86	1,870,300.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	415,354,255.96	412,579,195.54
未分配利润	6.4.7.10	172,494,851.03	157,054,202.90
所有者权益合计		587,849,106.99	569,633,398.44
负债和所有者权益总计		645,962,491.85	571,503,698.45

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4153 元，基金份额总额 415,354,255.96 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		18,612,693.78	71,322,441.53
1.利息收入		376,173.32	233,621.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	376,173.32	228,369.15
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		-	5,252.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,294,866.21	13,055,788.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	37,042,050.86	12,525,520.71
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,252,815.35	530,268.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-21,087,434.21	58,006,499.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	29,088.46	26,532.44
减：二、费用		9,337,662.85	4,923,019.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,167,562.58	1,963,180.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	316,756.22	196,317.97

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	5,733,063.01	2,632,847.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,662.71	24,835.77
7. 其他费用	6.4.7.21	118,618.33	105,838.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,275,030.93	66,399,421.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,275,030.93	66,399,421.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	412,579,195.54	157,054,202.90	569,633,398.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,275,030.93	9,275,030.93
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）	2,775,060.42	6,165,617.20	8,940,677.62
其中：1.基金申购款	138,742,697.87	62,515,967.90	201,258,665.77
2.基金赎回款	-135,967,637.45	-56,350,350.70	-192,317,988.15
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）	415,354,255.96	172,494,851.03	587,849,106.99
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	333,097,325.12	6,792,516.08	339,889,841.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,399,421.67	66,399,421.67
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)	64,005,681.37	3,253,751.87	67,259,433.24
其中：1.基金申购款	150,934,287.68	7,697,196.40	158,631,484.08
2.基金赎回款	-86,928,606.31	-4,443,444.53	-91,372,050.84
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)	397,103,006.49	76,445,689.62	473,548,696.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗凯

基金管理人负责人

罗凯

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

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可第[2019]1478号《关于准予诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)注册的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 332,986,013.47 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0670 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型证券投资基金(FOF)基金合同》于 2019 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 333,097,325.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 111,311.65 份基金

份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(但不包括 QDII 基金、香港互认基金)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不得投资分级基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。本基金的投资组合比例为：本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中股票型基金、混合型基金的投资比例合计占本基金资产的 60%-90%；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中国债券总指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	67,980,984.98
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：	67,980,984.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	496,337,617.71	534,961,182.67	38,623,564.96
其他	-	-	-
合计	496,337,617.71	534,961,182.67	38,623,564.96

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	22,012.92
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	2,935.10
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	0.03
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	346.00
合计	25,294.05

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	647,247.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	647,247.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
合计	94,219.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	412,579,195.54	412,579,195.54
本期申购	138,742,697.87	138,742,697.87
本期赎回(以“-”号填列)	-135,967,637.45	-135,967,637.45
- 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	415,354,255.96	415,354,255.96

6.4.7.10 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	87,323,094.18	69,731,108.72	157,054,202.90
本期利润	30,362,465.14	-21,087,434.21	9,275,030.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,532,437.72	3,633,179.48	6,165,617.20
其中：基金申购款	40,586,163.93	21,929,803.97	62,515,967.90
基金赎回款	-38,053,726.21	-18,296,624.49	-56,350,350.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	120,217,997.04	52,276,853.99	172,494,851.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	334,776.89
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	37,719.79
其他	3,676.64
合计	376,173.32

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	4,329,764,404.55
减：卖出/赎回基金成本总额	4,292,722,353.69
基金投资收益	37,042,050.86

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	2,252,815.35
合计	2,252,815.35

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-21,087,434.21
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-21,087,434.21
——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	-21,087,434.21

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,088.46
合计	29,088.46

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	5,733,063.01
其中：申购费	308,070.02
赎回费	4,053,618.81
交易费	1,371,374.18
合计	5,733,063.01

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	52,496.30
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,791,435.65
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	637,469.96

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

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	24,398.78
合计	118,618.33

6.4.7.22 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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
清华控股有限公司（“清华控股”）	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理(北京)有限公司（“宜信惠民”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,167,562.58	1,963,180.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,503,372.83	904,369.58

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 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	316,756.22	196,317.97

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 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**

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

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

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与持有转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：（1）决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；（2）执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；（3）监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、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具有托管资质的招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、

流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	67,980,984.98	-	-	-	-	-	67,980,984.98
结算备付金	6,522,647.72	-	-	-	-	-	6,522,647.72
存出保证金	768,902.97	-	-	-	-	-	768,902.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	534,961,182.67	534,961,182.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	35,235,172.99	35,235,172.99
应收利息	-	-	-	-	-	25,294.05	25,294.05
应收申购款	-	-	-	-	-	468,306.47	468,306.47
资产总计	75,272,535.67	-	-	-	-	570,689,956.18	645,962,491.85
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,769,229.69	17,769,229.69
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,020,923.08	39,020,923.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	528,877.77	528,877.77
应付托管费	-	-	-	-	-	52,887.77	52,887.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	647,247.00	647,247.00
其他负债	-	-	-	-	-	94,219.55	94,219.55

负债总计	-	-	-	-	-	58,113,384.86	58,113,384.86
利率敏感度缺口	75,272,535.67	-	-	-	-	-512,576,571.32	587,849,106.99
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	45,466,305.21	-	-	-	-	-	45,466,305.21
结算备付金	319,648.16	-	-	-	-	-	319,648.16
存出保证金	507,734.41	-	-	-	-	-	507,734.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-504,288,757.04	504,288,757.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-20,901,789.34	20,901,789.34
应收利息	-	-	-	-	-	19,464.29	19,464.29
资产总计	46,293,687.78	-	-	-	-	-525,210,010.67	571,503,698.45
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,136,203.19	1,136,203.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	460,058.92	460,058.92
应付托管费	-	-	-	-	-	46,005.89	46,005.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,265.90	49,265.90
其他负债	-	-	-	-	-	178,766.11	178,766.11
负债总计	-	-	-	-	-	1,870,300.01	1,870,300.01
利率敏感度缺口	46,293,687.78	-	-	-	-	-523,339,710.66	569,633,398.44

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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 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（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中股票型基金、混合型基金的的投资比例合计占本基金资产的 60%-90%；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	534,961,182.67	91.00	504,288,757.04	88.53
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	534,961,182.67	91.00	504,288,757.04	88.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 6 月） 上年度末（2020 年 12 月）

		30 日)	31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	26,288,612.06	21,586,257.63
	沪深 300 指数下降 5%	-26,288,612.06	-21,586,257.63

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	534,961,182.67	82.82
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	74,503,632.70	11.53
8	其他各项资产	36,497,676.48	5.65
9	合计	645,962,491.85	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%。本基金通过定量与定性相结合的方法对基金数据进行分析，获得符合本基金投资目标的备选基金池，再结合调研和公开数据收集等方式，筛选最终的投资标的。在此基础上，本基金通过相对分散的投资方式，构建基金组合，力求本基金资产的长期增值。本

基金为 FOF 产品，其风险和预期收益低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金符合基金合同约定的投资范围、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515030	华夏中证新能源汽车ETF	契约型开放式	6,800,000.00	14,402,400.00	2.45	否
2	005763	中欧电子信息产业C	契约型开放式	4,806,314.10	13,883,518.91	2.36	否
3	000294	华安生态优先	契约型开放式	2,623,200.00	13,320,609.60	2.27	否
4	161616	融通医疗保健行业A	契约型开放式	3,912,898.13	13,162,989.31	2.24	否
5	001532	华安文体健康混合	契约型开放式	3,762,498.37	12,649,519.52	2.15	否
6	001695	泓德泓业	契约型开放式	4,833,800.00	12,612,350.96	2.15	否
7	450003	国富潜力组合混合A	契约型开放式	6,634,700.00	12,546,217.70	2.13	否
8	002340	富国价值优势混合	契约型开放式	3,142,500.00	12,516,577.50	2.13	否
9	001054	工银瑞信新金融	契约型开放式	3,855,100.00	12,502,089.30	2.13	否
10	159949	华安创业板50ETF	契约型开放式	8,100,000.00	12,474,000.00	2.12	否
11	001736	圆信永丰优加生活	契约型开放式	3,798,166.57	12,473,179.02	2.12	否
12	166801	浙商聚潮新思维	契约型开放式	3,821,700.00	12,447,276.90	2.12	否
13	001043	工银美丽城镇股票	契约型开放式	4,259,200.00	12,424,086.40	2.11	否
14	006179	富国品质	契约型开	5,351,900.00	12,385,366.98	2.11	否

		生活	放式				
15	519133	海富通改革驱动	契约型开放式	4,473,600.00	12,306,873.60	2.09	否
16	070018	嘉实回报灵活配置	契约型开放式	6,012,600.00	12,277,729.20	2.09	否
17	002593	富国美丽中国混合	契约型开放式	4,080,400.00	12,269,762.80	2.09	否
18	005739	富国转型机遇	契约型开放式	5,379,200.00	12,260,272.64	2.09	否
19	070013	嘉实研究精选A	契约型开放式	4,432,000.00	12,258,912.00	2.09	否
20	001186	富国文体健康	契约型开放式	4,859,000.00	12,244,680.00	2.08	否
21	750001	安信灵活配置混合	契约型开放式	4,271,100.00	12,240,972.60	2.08	否
22	110009	易方达价值精选混合	契约型开放式	8,159,400.00	12,238,284.06	2.08	否
23	000457	上投摩根核心成长	契约型开放式	4,228,300.45	12,230,359.05	2.08	否
24	005760	富国周期优势混合	契约型开放式	3,950,600.00	12,214,860.14	2.08	否
25	161834	银华鑫锐灵活配置	契约型开放式	7,099,000.00	12,210,280.00	2.08	否
26	000577	安信价值精选	契约型开放式	2,337,572.54	12,202,128.66	2.08	否
27	163409	兴全绿色投资混合(LOF)	契约型开放式	5,372,200.00	12,189,521.80	2.07	否
28	040020	华安升级主题混合	契约型开放式	4,274,600.00	12,182,610.00	2.07	否
29	450004	国富深化价值混合	契约型开放式	4,112,642.29	12,140,520.04	2.07	否
30	159967	华夏创业板动量成长ETF	契约型开放式	14,400,000.00	12,038,400.00	2.05	否
31	006751	富国互联科技	契约型开放式	3,570,900.00	10,562,365.11	1.80	否
32	519199	万家家享中短债A	契约型开放式	9,512,891.26	10,000,902.58	1.70	否
33	001871	前海开源货币B	契约型开放式	10,000,588.65	10,000,588.65	1.70	否
34	001171	工银瑞信	契约型开	3,959,676.38	9,697,247.45	1.65	否

		养老产业	放式				
35	512480	国联安中证全指半导体ETF	契约型开放式	6,200,000.00	8,277,000.00	1.41	否
36	005875	易方达中盘成长混合	契约型开放式	2,223,248.49	6,895,405.19	1.17	否
37	510330	华夏沪深300ETF	契约型开放式	1,300,000.00	6,831,500.00	1.16	否
38	163807	中银行业优选	契约型开放式	3,958,647.56	6,747,514.77	1.15	否
39	001184	易方达新常态	契约型开放式	8,492,921.49	6,683,929.21	1.14	否
40	519673	银河康乐	契约型开放式	1,807,900.00	6,508,440.00	1.11	否
41	450009	国富中小盘	契约型开放式	2,303,000.00	6,505,975.00	1.11	否
42	005267	嘉实价值精选	契约型开放式	2,865,068.08	6,430,645.31	1.09	否
43	202009	南方盛元红利混合	契约型开放式	4,322,900.00	6,402,214.90	1.09	否
44	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	契约型开放式	1,200,000.00	6,307,200.00	1.07	否
45	163417	兴全合宜A	契约型开放式	3,000,000.00	6,239,100.00	1.06	否
46	519714	交银消费新驱动	契约型开放式	2,693,800.00	6,230,759.40	1.06	否
47	159995	华夏国证半导体芯片ETF	契约型开放式	3,900,000.00	6,177,600.00	1.05	否
48	002446	广发利鑫	契约型开放式	2,066,400.00	6,137,208.00	1.04	否
49	169104	东方红睿满沪港深混合(LOF)	契约型开放式	2,123,622.69	6,084,179.01	1.03	否
50	270022	广发内需增长	契约型开放式	3,220,700.00	5,971,177.80	1.02	否
51	512170	华宝中证医疗ETF	契约型开放式	6,270,382.00	5,900,429.46	1.00	否
52	002910	易方达供给改革	契约型开放式	1,741,900.00	3,754,665.45	0.64	否

53	512690	鹏华中证酒ETF	契约型开放式	2,100,000.00	2,988,300.00	0.51	否
54	512800	华宝中证银行ETF	契约型开放式	1,000,000.00	1,230,000.00	0.21	否
55	159806	国泰中证新能源汽车ETF	契约型开放式	402,100.00	1,088,886.80	0.19	否
56	511990	华宝添益	契约型开放式	16.00	1,599.89	0.00	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，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情况，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。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	768,902.97
2	应收证券清算款	35,235,172.99
3	应收股利	-
4	应收利息	25,294.05
5	应收申购款	468,306.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,497,676.48

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
13,853	29,982.98	3,932,103.86	0.95%	411,422,152.10	99.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月9日）基金份额总额	333,097,325.12
本报告期期初基金份额总额	412,579,195.54
本报告期基金总申购份额	138,742,697.87
减：本报告期基金总赎回份额	135,967,637.45
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	415,354,255.96

§ 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) 2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

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、公募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 本报告持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2021 年度的基金审计机构，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供连续 2 年的审计服务。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
财信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	1,051,658.48	100.00%	-

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：平安证券，退租交易单元：无。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	6,979,165,547.96	100.00%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司申购(含定期定额投资)业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年1月15日
2	诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2020年第4季度报告	指定互联网网站	2021年1月22日
3	诺德基金管理有限公司旗下部分基金2020年第4季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021年1月22日
4	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）基金销售有限公司申（认）购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年1月30日
5	诺德基金管理有限公司关于诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回业务的公告	四大报、指定互联网网站	2021年2月5日
6	诺德基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	四大报、指定互联网网站	2021年2月8日
7	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司申购（含定期定额投资）、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年2月23日
8	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021年3月10日
9	诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2020年年度报告	指定互联网网站	2021年3月30日
10	诺德基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021年3月30日
11	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西南证券股份有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021年3月31日
12	诺德大类精选配置三个月定期开	指定互联网网站	2021年4月22日

	放混合型基金中基金（FOF）2021 年第 1 季度报告		
13	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
14	诺德基金管理有限公司关于调整微信网上直销业务优惠费率的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 22 日
15	诺德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 4 月 24 日
16	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 17 日
17	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富（上海）基金销售有限公司 申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 5 月 29 日
18	诺德基金管理有限公司关于诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回业务的公告	证券日报、指定互联网网站	2021 年 6 月 4 日
19	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京虹点基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 19 日
20	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京度小满基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日
21	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海爱建基金销售有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2021 年 6 月 22 日

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内没有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）基金合同》。
- 3、《诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）2021 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

2021 年 8 月 28 日