

# 诺德天富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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
3.3 其他指标	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>68</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 .....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺德天富灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺德天富
基金主代码	005295
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 7 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,289,244.37 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以价值投资为基础，通过对市场运行规律的预判，动态调整投资组合，在严格控制风险并保证流动性的前提下，力求获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究为基础，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，对基金资产进行灵活资产配置，在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈培阳	罗菲菲
	联系电话	021-68985266	010-58560666
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0009	95568
传真		021-68985121	010-57093382
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	潘福祥	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-10,962,208.53
本期利润	-20,367,861.52
加权平均基金份额本期利润	-0.2194
本期加权平均净值利润率	-16.38%
本期基金份额净值增长率	-9.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	7,651,336.63
期末可供分配基金份额利润	0.2526
期末基金资产净值	40,030,047.87
期末基金份额净值	1.3216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	32.16%

- 注：1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。
- 3、 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 4、 本基金合同生效日为 2018 年 2 月 7 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	6.61%	0.90%	2.80%	0.32%	3.81%	0.58%
过去三个月	2.31%	1.30%	2.75%	0.42%	-0.44%	0.88%
过去六个月	-9.35%	1.31%	-1.31%	0.44%	-8.04%	0.87%
过去一年	-3.38%	1.04%	-0.61%	0.37%	-2.77%	0.67%
过去三年	35.76%	0.88%	16.48%	0.37%	19.28%	0.51%
自基金合同	32.16%	0.91%	22.93%	0.39%	9.23%	0.52%

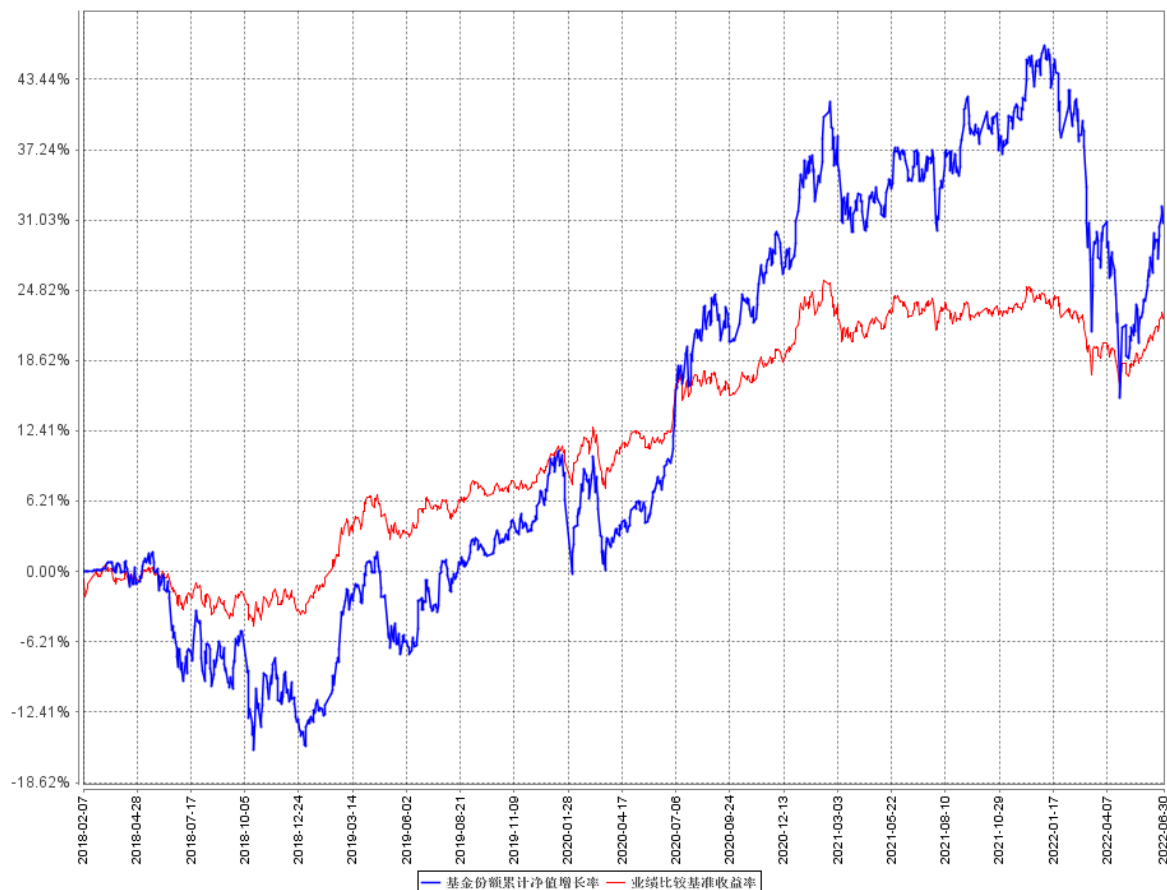


生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：业绩比较基准=中证全债指数\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%

### 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：本基金的合同于 2018 年 2 月 7 日生效，图示时间段为 2018 年 2 月 7 日至 2022 年 6 月 30 日。本基金建仓期间自 2018 年 2 月 7 日至 2018 年 8 月 6 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。公司股东为天府清源控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了三十五只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金、诺德新能源汽车混合型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾文宏	本基金基金经理以及诺德量化蓝筹增强混合型证券投资	2018 年 2 月 10 日	-	10	华中师范大学数量经济学硕士。2012 年 6 月至 2014 年 7 月于上海大智慧股份有限公司担任行业研究员兼产品经理，2014 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业部高级研究

	基金的 基金经 理				员, FOF 管理部投资经理 等职务, 具有基金从业资格。
--	-----------------	--	--	--	----------------------------------

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

2、证券从业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

2022 年国内宏观经济处于探底伴随结构转型升级的过程中。就股票二级市场而言, 2022 年上

半年具体表现为：上证综指跌幅 6.63%，上证 50 跌幅 6.59%，沪深 300 指数跌幅 9.22%，中证 500 指数跌幅 12.3%，创业板指数跌幅 15.41%。

2022 年上半年本基金通过仓位控制策略、行业配置策略、个股精选策略等，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇。坚守价值投资理念的同时，本基金争取获取超越业绩基准的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3216 元，累计净值为 1.3216 元。本报告期份额净值增长率为-9.35%，同期业绩比较基准增长率为-1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济整体依旧处于构筑底部的大背景中，从基本上，我们看出中国的宏观经济之前表现出了较好的韧性，经济恢复情况较好。国际层面上来说，美国经济冲顶迹象明显，美国通胀高企，美联储货币收紧时点值得关注。我们认为在 2022 年 A 股市场依旧存在机会，将继续关注业绩反转和业绩超预期的公司，同时需要注意回避业绩可能存疑的个股。我们认为低位价值股回归的同时，科创板和创业板在进一步调整之后依然有不错的机会，操作上注意规避业绩存疑的个股，关注真正能成长起来的公司，有望获得超额回报。全年来看，预计 2022 年国企改革真正落实的相关标的，以及资本市场改革背景下，券商行业以及核心资产中业绩和估值匹配的龙头股票，其投资机会都有可能贯穿 2022 整年。

本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度，以低估值沪深 300 配置为主，适当关注业绩逐步体现的成长公司，主要通过合理配置资产权重，精选个股，力求实现基金资产的长期、稳定增值。2022 年可能是经济回落但是政策刺激的一年，不一定会有整体系统性的行情，但是阶段和个股机会依旧精彩，本基金将力争抓住结构性的机会，努力为投资者创造更好的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 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：诺德天富灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,900,731.20	14,972,215.06
结算备付金		130,130.76	15,129,197.30
存出保证金		41,800.70	29,376.47
交易性金融资产	6.4.7.2	34,461,546.56	194,823,756.78
其中：股票投资		34,461,546.56	194,823,756.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	160,472.89
应收股利		-	-
应收申购款		134.80	154.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		40,534,344.02	225,115,173.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		184,946.80	-

应付赎回款		14,320.27	24.59
应付管理人报酬		29,795.34	113,753.08
应付托管费		4,965.91	18,958.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	270,267.83	196,064.66
负债合计		504,296.15	328,801.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	30,289,244.37	154,184,436.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,740,803.50	70,601,935.67
净资产合计		40,030,047.87	224,786,372.08
负债和净资产总计		40,534,344.02	225,115,173.27

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3216 元，基金份额总额 30,289,244.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺德天富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-19,840,109.32	11,718,108.52
1.利息收入		57,456.16	267,641.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	57,456.16	190,593.08
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		-	77,048.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,570,703.42	18,959,558.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,211,821.21	17,512,278.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,869.45	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	630,248.34	1,447,280.49
以摊余成本计量的金融资		-	-



产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-9,405,652.99	-7,634,970.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	78,790.93	125,878.58
<b>减：二、营业总支出</b>		527,752.20	873,215.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	375,850.29	671,961.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	62,641.76	111,993.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,260.15	89,260.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-20,367,861.52	10,844,892.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-20,367,861.52	10,844,892.73
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-20,367,861.52	10,844,892.73

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺德天富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	154,184,436.41	-	70,601,935.67	224,786,372.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	154,184,436.41	-	70,601,935.67	224,786,372.08

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-123,895,192.04	-	-60,861,132.17	-184,756,324.21
(一)、综合收益总额	-	-	-20,367,861.52	-20,367,861.52
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-123,895,192.04	-	-40,493,270.65	-164,388,462.69
其中：1.基金申购款	7,184,807.50	-	2,968,081.07	10,152,888.57
2.基金赎回款	-131,079,999.54	-	-43,461,351.72	-174,541,351.26
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	30,289,244.37	-	9,740,803.50	40,030,047.87
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	167,178,492.79	-	51,610,635.05	218,789,127.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	167,178,492.79	-	51,610,635.05	218,789,127.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,046,808.56	-	13,198,869.56	22,245,678.12
(一)、综合收益总额	-	-	10,844,892.73	10,844,892.73
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	9,046,808.56	-	2,353,976.83	11,400,785.39
其中：1.基金申购款	82,331,894.33	-	27,928,078.10	110,259,972.43
2.基金赎回款	-73,285,085.77	-	-25,574,101.27	-98,859,187.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	176,225,301.35	-	64,809,504.61	241,034,805.96

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 _____	_____ 罗凯 _____	_____ 高奇 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

诺德天富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[2017]624号《关于准予诺德天富灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《诺德天富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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 265,591,050.49 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(2018)第 0099 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德天富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 265,609,851.46 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,800.97 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德天富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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备

付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $70\% \times$  中证全债指数收益率 $+30\% \times$  沪深 300 指数收益率。

#### 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》、《诺德天富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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

-

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。



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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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**

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

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

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,无期初留存收益影响。

#### b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	5,900,731.20
等于：本金	5,899,214.84
加：应计利息	1,516.36
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	5,900,731.20

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,782,285.41	-	34,461,546.56	-3,320,738.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,782,285.41	-	34,461,546.56	-3,320,738.85

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

不适用。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

不适用。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

不适用。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

不适用。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

不适用。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

不适用。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	61,007.68
其中：交易所市场	61,007.68
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	209,260.15
合计	270,267.83

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	154,184,436.41	154,184,436.41
本期申购	7,184,807.50	7,184,807.50
本期赎回(以“-”号填列)	-131,079,999.54	-131,079,999.54
- 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	30,289,244.37	30,289,244.37

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

不适用。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	71,909,009.73	-1,307,074.06	70,601,935.67
本期利润	-10,962,208.53	-9,405,652.99	-20,367,861.52
本期基金份额交易产生的变动数	-53,295,464.57	12,802,193.92	-40,493,270.65
其中：基金申购款	3,365,839.98	-397,758.91	2,968,081.07
基金赎回款	-56,661,304.55	13,199,952.83	-43,461,351.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,651,336.63	2,089,466.87	9,740,803.50

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	46,229.53
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	10,615.27
其他	611.36
合计	57,456.16

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	157,295,624.41
减：卖出股票成本总额	168,201,328.62
减：交易费用	306,117.00



买卖股票差价收入	-11,211,821.21
----------	----------------

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.66
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	10,864.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,869.45

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,869.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	35,000.00
减：应计利息总额	4.66
减：交易费用	0.05
买卖债券差价收入	10,864.79

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	630,248.34
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	630,248.34

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,405,652.99
——股票投资	-9,405,652.99
——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 增值税	-
合计	-9,405,652.99

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	78,790.93
合计	78,790.93

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金对持续持有基金份额少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于30日（含）但少于90日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有基金份额长于90日（含）但少于180日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产。

2. 基金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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内未计提信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,260.15

#### 6.4.7.24 分部报告

不适用。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
天府清源控股有限公司（“天府清源”）	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理(北京)有限公司（“宜信惠民”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	375,850.29	671,961.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,894.02	5,982.14

注：支付基金管理人诺德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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 X0.60% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	62,641.76	111,993.69

注：支付基金托管人中国民生银行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自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自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国民生银行	5,900,731.20	46,229.53	37,549,068.51	180,478.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688331	荣昌生物	2022年3月24日	1-6个月(含)	新股流通受限	48.00	42.94	1,920	92,160.00	82,444.80	-
688220	翱捷科技	2022年1月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	164.54	68.59	1,047	172,273.38	71,813.73	-
688175	高凌信息	2022年3月8日	1-6个月(含)	新股流通受限	51.68	32.23	1,096	56,641.28	35,324.08	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	3.80	6.39	2,055	7,809.00	13,131.45	-
301116	益客食品	2022年1月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	1-6个月(含)	新股流通受限	17.27	14.83	606	10,465.62	8,986.98	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	1-6个月(含)	新股流通受限	46.80	54.44	165	7,722.00	8,982.60	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.30	37.93	236	9,274.80	8,951.48	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	1-6个月(含)	新股流通受限	72.69	71.54	116	8,432.04	8,298.64	-
301130	西点药业	2022年2月16日	1-6个月	新股流通受限	22.55	37.70	210	4,735.50	7,917.00	-

		日	(含)								
301158	德石股份	2022年1月7日	1-6个月(含)	新股流通受限	15.64	20.38	369	5,771.16	7,520.22		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	1-6个月(含)	新股流通受限	19.93	31.38	207	4,125.51	6,495.66		-
301256	华融化学	2022年3月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	8.05	10.08	607	4,886.35	6,118.56		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	15.37	15.99	361	5,548.57	5,772.39		-
301200	大族数控	2022年2月18日	1-6个月(含)	新股流通受限	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	1-6个月(含)	新股流通受限	29.67	33.28	167	4,954.89	5,557.76		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	56.88	56.42	97	5,517.36	5,472.74		-
301123	奕东电子	2022年1月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	37.23	25.39	193	7,185.39	4,900.27		-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	42.50	32.02	151	4,930.00	4,835.02		-
301268	铭利达	2022年3月29日	1-6个月(含)	新股流通受限	28.50	34.87	138	3,933.00	4,812.06		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	1-6个月(含)	新股流通受限	33.98	28.96	149	5,063.02	4,315.04		-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.88	31.09	133	5,304.04	4,134.97		-
301109	军信股份	2022年4月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	34.81	16.14	249	5,778.46	4,018.86		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	40.25	30.59	129	5,192.25	3,946.11		-



300834	星辉环材	2022年1月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	55.57	30.03	127	7,057.39	3,813.81	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	173.98	87.82	43	4,175.52	3,776.26	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	1-6个月(含)	新股流通受限	56.69	41.86	87	4,932.03	3,641.82	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.98	26.26	127	4,061.46	3,335.02	-
301258	富士莱	2022年3月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	48.30	41.68	78	3,767.40	3,251.04	-
301110	青木股份	2022年3月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	63.10	39.85	81	5,111.10	3,227.85	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	35.68	29.84	108	3,853.44	3,222.72	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	30.82	21.46	146	4,499.72	3,133.16	-
301279	金道科技	2022年4月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.20	22.81	127	3,962.40	2,896.87	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	64.08	37.52	73	4,677.84	2,738.96	-

注:1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不

低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002411	延安必康	2022年5月5日	重大事项	6.55	2022年7月1日	6.22	2,800	50,029.00	18,340.00	-

注：本基金截至 2022 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。

#### 6.4.12.4 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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民生银行，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；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 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2021 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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	5,900,731.20	-	-	-	-	-	5,900,731.20
结算备付金	130,130.76	-	-	-	-	-	130,130.76
存出保证金	41,800.70	-	-	-	-	-	41,800.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	34,461,546.56	34,461,546.56
应收申购款	-	-	-	-	-	134.80	134.80
资产总计	6,072,662.66	-	-	-	-	34,461,681.36	40,534,344.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,320.27	14,320.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,795.34	29,795.34
应付托管费	-	-	-	-	-	4,965.91	4,965.91
其他负债	-	-	-	-	-	455,214.63	455,214.63
负债总计	-	-	-	-	-	504,296.15	504,296.15
利率敏感度缺口	6,072,662.66	-	-	-	-	33,957,385.21	40,030,047.87
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	14,968,869.19	-	-	-	-	-	14,968,869.19
结算备付金	15,121,634.91	-	-	-	-	-	15,121,634.91
存出保证金	29,361.95	-	-	-	-	-	29,361.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	194,823,756.78	194,823,756.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	160,472.89	160,472.89
应收申购款	-	-	-	-	-	154.77	154.77

其他资产	-	-	-	-	10,922.78	10,922.78
资产总计	30,119,866.05	-	-	-	194,995,307.22	225,115,173.27
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	24.59	24.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	113,753.08	113,753.08
应付托管费	-	-	-	-	18,958.86	18,958.86
其他负债	-	-	-	-	196,064.66	196,064.66
负债总计	-	-	-	-	328,801.19	328,801.19
利率敏感度缺口	30,119,866.05	-	-	-	-194,666,506.03	224,786,372.08

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其

中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	34,461,546.56	86.09	194,823,756.78	86.67
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	34,461,546.56	86.09	194,823,756.78	86.67

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		1,661,847.44
沪深 300 指数下降 5%		-1,661,847.44	-6,853,736.48

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。



第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	34,097,293.93	191,448,069.74
第二层次	-	72,211.81
第三层次	364,252.63	3,303,475.23
合计	34,461,546.56	194,823,756.78

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动#

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年6月30日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,461,546.56	85.02
	其中：股票	34,461,546.56	85.02
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	6,030,861.96	14.88
8	其他各项资产	41,935.50	0.10
9	合计	40,534,344.02	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,731,717.12	6.82
C	制造业	13,138,538.29	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,272,449.00	3.18
E	建筑业	1,173,135.60	2.93
F	批发和零售业	681,680.26	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	1,521,363.00	3.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,305,072.72	3.26
J	金融业	11,200,403.85	27.98
K	房地产业	286,884.00	0.72
L	租赁和商务服务业	675,729.97	1.69
M	科学研究和技术服务业	22,082.93	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	75,865.80	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	130,717.02	0.33
R	文化、体育和娱乐业	245,907.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	34,461,546.56	86.09

### 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	600036	招商银行	40,000	1,688,000.00	4.22
2	600030	中信证券	70,000	1,516,200.00	3.79
3	600309	万华化学	13,300	1,289,967.00	3.22
4	600887	伊利股份	30,000	1,168,500.00	2.92
5	601108	财通证券	135,070	1,063,000.90	2.66
6	600837	海通证券	100,000	981,000.00	2.45
7	601899	紫金矿业	100,000	933,000.00	2.33
8	600380	健康元	70,000	864,500.00	2.16
9	600000	浦发银行	102,600	821,826.00	2.05
10	601211	国泰君安	50,000	760,000.00	1.90
11	601688	华泰证券	50,600	718,520.00	1.79
12	601818	光大银行	211,300	636,013.00	1.59
13	605368	蓝天燃气	50,000	630,000.00	1.57
14	601128	常熟银行	82,300	628,772.00	1.57
15	605186	健麾信息	20,000	614,800.00	1.54
16	600519	贵州茅台	300	613,500.00	1.53
17	601318	中国平安	12,500	583,625.00	1.46
18	600585	海螺水泥	16,400	578,592.00	1.45
19	600690	海尔智家	20,700	568,422.00	1.42
20	600999	招商证券	38,980	561,701.80	1.40
21	601225	陕西煤业	25,900	548,562.00	1.37
22	000977	浪潮信息	20,000	529,600.00	1.32
23	603533	掌阅科技	30,000	483,000.00	1.21
24	600028	中国石化	117,000	477,360.00	1.19
25	601888	中国中免	2,000	465,860.00	1.16

26	002311	海大集团	7,600	456,076.00	1.14
27	601919	中远海控	32,240	448,136.00	1.12
28	605358	立昂微	6,200	417,756.00	1.04
29	002352	顺丰控股	7,400	412,994.00	1.03
30	600170	上海建工	129,600	392,688.00	0.98
31	601857	中国石油	70,400	373,120.00	0.93
32	600196	复星医药	8,100	357,129.00	0.89
33	600570	恒生电子	7,462	324,895.48	0.81
34	601186	中国铁建	39,300	310,470.00	0.78
35	000157	中联重科	48,701	299,998.16	0.75
36	002221	东华能源	30,000	279,300.00	0.70
37	600050	中国联通	80,700	279,222.00	0.70
38	000876	新希望	18,200	278,460.00	0.70
39	601989	中国重工	69,800	258,958.00	0.65
40	300144	宋城演艺	16,020	245,907.00	0.61
41	000425	徐工机械	44,800	241,472.00	0.60
42	000895	双汇发展	8,100	237,330.00	0.59
43	600741	华域汽车	10,100	232,300.00	0.58
44	601139	深圳燃气	30,000	208,200.00	0.52
45	603288	海天味业	2,231	201,593.16	0.50
46	600031	三一重工	10,000	190,600.00	0.48
47	601800	中国交建	20,400	189,312.00	0.47
48	601390	中国中铁	30,000	184,200.00	0.46
49	300033	同花顺	1,800	173,070.00	0.43
50	601901	方正证券	25,700	172,447.00	0.43
51	603019	中科曙光	5,880	170,637.60	0.43
52	600352	浙江龙盛	16,600	168,988.00	0.42
53	002120	韵达股份	9,100	155,246.00	0.39
54	002422	科伦药业	8,100	151,470.00	0.38
55	600674	川投能源	11,700	139,464.00	0.35
56	000630	铜陵有色	40,200	131,052.00	0.33
57	601607	上海医药	7,200	130,176.00	0.33
58	300017	网宿科技	24,000	128,640.00	0.32
59	002044	美年健康	22,600	125,882.00	0.31
60	600111	北方稀土	3,500	123,060.00	0.31
61	603260	合盛硅业	1,020	120,319.20	0.30
62	600487	亨通光电	8,200	119,228.00	0.30
63	600153	建发股份	9,100	118,937.00	0.30
64	601898	中煤能源	11,200	116,256.00	0.29

65	002027	分众传媒	16,500	111,045.00	0.28
66	601658	邮储银行	20,000	107,800.00	0.27
67	600061	国投资本	16,720	106,339.20	0.27
68	601216	君正集团	20,900	101,992.00	0.25
69	300136	信维通信	6,000	101,100.00	0.25
70	600340	华夏幸福	31,200	99,840.00	0.25
71	600516	方大炭素	13,020	98,952.00	0.25
72	600004	白云机场	6,600	98,406.00	0.25
73	601018	宁波港	25,100	97,890.00	0.24
74	600606	绿地控股	24,360	96,465.60	0.24
75	601878	浙商证券	8,400	95,592.00	0.24
76	601138	工业富联	9,700	95,448.00	0.24
77	601727	上海电气	23,200	95,352.00	0.24
78	002798	帝欧家居	10,000	95,000.00	0.24
79	600415	小商品城	17,000	94,690.00	0.24
80	601998	中信银行	19,800	94,050.00	0.23
81	000709	河钢股份	41,200	93,112.00	0.23
82	600660	福耀玻璃	2,200	91,982.00	0.23
83	600023	浙能电力	26,300	91,261.00	0.23
84	600009	上海机场	1,600	90,720.00	0.23
85	600038	中直股份	2,000	90,400.00	0.23
86	600489	中金黄金	11,200	82,768.00	0.21
87	600027	华电国际	21,000	82,530.00	0.21
88	688331	荣昌生物	1,920	82,444.80	0.21
89	600271	航天信息	7,200	78,768.00	0.20
90	601198	东兴证券	8,700	77,430.00	0.19
91	002832	比音勒芬	3,060	77,112.00	0.19
92	600208	新湖中宝	27,300	75,348.00	0.19
93	600737	中粮糖业	10,000	75,200.00	0.19
94	600118	中国卫星	3,700	74,296.00	0.19
95	600566	济川药业	2,700	73,332.00	0.18
96	601997	贵阳银行	12,400	72,044.00	0.18
97	688220	翱捷科技	1,047	71,813.73	0.18
98	600346	恒力石化	3,200	71,168.00	0.18
99	600482	中国动力	4,500	70,695.00	0.18
100	600372	中航电子	3,600	69,804.00	0.17
101	002938	鹏鼎控股	2,300	69,483.00	0.17
102	600066	宇通客车	8,000	69,200.00	0.17
103	600010	包钢股份	29,300	68,855.00	0.17

104	601633	长城汽车	1,800	66,672.00	0.17
105	600498	烽火通信	4,400	63,712.00	0.16
106	000627	天茂集团	18,400	62,744.00	0.16
107	300070	碧水源	12,000	62,520.00	0.16
108	601006	大秦铁路	9,400	61,946.00	0.15
109	000629	攀钢钒钛	16,300	61,940.00	0.15
110	600588	用友网络	2,730	59,268.30	0.15
111	601992	金隅集团	21,100	58,447.00	0.15
112	600583	海油工程	14,000	58,100.00	0.15
113	600547	山东黄金	3,052	56,645.12	0.14
114	600398	海澜之家	11,800	56,050.00	0.14
115	000656	金科股份	19,100	54,626.00	0.14
116	601808	中海油服	3,900	54,405.00	0.14
117	600886	国投电力	5,100	53,550.00	0.13
118	600297	广汇汽车	20,500	53,505.00	0.13
119	601377	兴业证券	7,500	52,875.00	0.13
120	601600	中国铝业	10,500	49,875.00	0.12
121	000898	鞍钢股份	15,200	48,944.00	0.12
122	600011	华能国际	6,800	47,872.00	0.12
123	600233	圆通速递	2,300	46,897.00	0.12
124	601877	正泰电器	1,300	46,514.00	0.12
125	601838	成都银行	2,800	46,424.00	0.12
126	000961	中南建设	15,200	46,360.00	0.12
127	601555	东吴证券	6,591	45,675.63	0.11
128	601228	广州港	12,200	44,774.00	0.11
129	600998	九州通	3,700	44,067.00	0.11
130	600688	上海石化	13,600	43,248.00	0.11
131	600085	同仁堂	800	42,304.00	0.11
132	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.09
133	688175	高凌信息	1,096	35,324.08	0.09
134	600115	中国东航	6,200	34,038.00	0.09
135	600339	中油工程	10,900	31,501.00	0.08
136	600018	上港集团	5,200	30,316.00	0.08
137	600705	中航产融	8,500	29,410.00	0.07
138	600332	白云山	900	28,431.00	0.07
139	601933	永辉超市	6,300	26,964.00	0.07
140	603920	世运电路	1,300	22,490.00	0.06
141	600390	五矿资本	4,200	20,538.00	0.05
142	600867	通化东宝	1,900	19,646.00	0.05

143	002958	青农商行	5,900	19,588.00	0.05
144	600025	华能水电	2,800	19,572.00	0.05
145	601319	中国人保	3,700	18,722.00	0.05
146	002411	延安必康	2,800	18,340.00	0.05
147	600369	西南证券	4,500	17,865.00	0.04
148	600733	北汽蓝谷	1,800	16,686.00	0.04
149	601577	长沙银行	2,100	16,653.00	0.04
150	600535	天士力	1,500	15,765.00	0.04
151	600704	物产中大	2,700	13,851.00	0.03
152	301215	中汽股份	2,055	13,131.45	0.03
153	601162	天风证券	3,924	12,478.32	0.03
154	603160	汇顶科技	200	12,386.00	0.03
155	301116	益客食品	577	11,805.42	0.03
156	601212	白银有色	4,200	11,592.00	0.03
157	001268	联合精密	409	11,337.48	0.03
158	000402	金融街	1,800	10,710.00	0.03
159	301127	天源环保	838	9,326.94	0.02
160	301217	铜冠铜箔	606	8,986.98	0.02
161	301117	佳缘科技	165	8,982.60	0.02
162	301235	华康医疗	236	8,951.48	0.02
163	301177	迪阿股份	113	8,384.60	0.02
164	301201	诚达药业	116	8,298.64	0.02
165	301211	亨迪药业	377	8,173.36	0.02
166	301130	西点药业	210	7,917.00	0.02
167	301138	华研精机	254	7,810.50	0.02
168	301158	德石股份	369	7,520.22	0.02
169	301221	光庭信息	112	7,260.96	0.02
170	301263	泰恩康	207	6,495.66	0.02
171	301199	迈赫股份	197	6,311.88	0.02
172	301256	华融化学	607	6,118.56	0.02
173	601360	三六零	700	5,964.00	0.01
174	301137	哈焊华通	361	5,772.39	0.01
175	301200	大族数控	109	5,659.28	0.01
176	301212	联盛化学	167	5,557.76	0.01
177	301190	善水科技	233	5,529.09	0.01
178	301207	华兰疫苗	97	5,472.74	0.01
179	301193	家联科技	198	5,375.70	0.01
180	301182	凯旺科技	223	5,298.48	0.01
181	301100	风光股份	244	5,265.52	0.01

182	301123	奕东电子	193	4,900.27	0.01
183	301103	何氏眼科	151	4,835.02	0.01
184	301268	铭利达	138	4,812.06	0.01
185	301179	泽宇智能	113	4,611.53	0.01
186	301222	浙江恒威	149	4,315.04	0.01
187	301102	兆讯传媒	133	4,134.97	0.01
188	301109	军信股份	249	4,018.86	0.01
189	301181	标榜股份	129	3,946.11	0.01
190	301189	奥尼电子	116	3,863.96	0.01
191	300834	星辉环材	127	3,813.81	0.01
192	301219	腾远钴业	43	3,776.26	0.01
193	301108	洁雅股份	93	3,680.01	0.01
194	301237	和顺科技	87	3,641.82	0.01
195	301135	瑞德智能	127	3,335.02	0.01
196	301258	富士莱	78	3,251.04	0.01
197	301110	青木股份	81	3,227.85	0.01
198	301216	万凯新材	108	3,222.72	0.01
199	301151	冠龙节能	146	3,133.16	0.01
200	301279	金道科技	127	2,896.87	0.01
201	301196	唯科科技	73	2,738.96	0.01

## 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	保利发展	1,899,000.00	0.84
2	601668	中国建筑	1,359,200.00	0.60
3	300624	万兴科技	1,048,474.00	0.47
4	601899	紫金矿业	997,460.00	0.44
5	002317	众生药业	891,000.00	0.40
6	601318	中国平安	859,384.00	0.38
7	605186	健麾信息	777,600.00	0.35
8	000739	普洛药业	645,182.00	0.29
9	603533	掌阅科技	630,000.00	0.28
10	603517	绝味食品	603,530.00	0.27
11	601088	中国神华	577,170.00	0.26



12	002002	鸿达兴业	537,000.00	0.24
13	600030	中信证券	517,748.40	0.23
14	300750	宁德时代	496,000.00	0.22
15	600519	贵州茅台	485,400.00	0.22
16	605358	立昂微	416,464.00	0.19
17	601108	财通证券	211,956.00	0.09
18	688197	首药控股	207,400.20	0.09
19	688220	翱捷科技	172,273.38	0.08
20	688062	迈威生物	152,006.40	0.07

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	601318	中国平安	5,655,606.80	2.52
2	600519	贵州茅台	5,587,891.00	2.49
3	600030	中信证券	4,242,471.80	1.89
4	601668	中国建筑	4,214,212.00	1.87
5	601288	农业银行	3,338,880.00	1.49
6	601328	交通银行	2,746,508.00	1.22
7	600048	保利发展	2,728,261.00	1.21
8	000002	万科 A	2,631,846.00	1.17
9	300059	东方财富	2,625,677.42	1.17
10	600036	招商银行	2,469,542.72	1.10
11	002317	众生药业	2,407,969.00	1.07
12	002237	恒邦股份	2,372,254.00	1.06
13	000333	美的集团	2,257,398.00	1.00
14	000651	格力电器	2,246,062.00	1.00
15	601939	建设银行	2,195,545.00	0.98
16	601166	兴业银行	2,151,720.00	0.96
17	000546	金圆股份	2,141,600.30	0.95
18	000858	五粮液	2,086,030.00	0.93
19	600216	浙江医药	2,050,454.00	0.91
20	601398	工商银行	1,888,460.00	0.84

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	17,244,771.39
卖出股票收入（成交）总额	157,295,624.41

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，招商银行（600036）的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）、海通证券（600837）的发行主体海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）、浦发银行（600000）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）存在被监管公开处罚的情形。

1、招商银行（600036）

根据 2022 年 3 月 21 日的行政处罚决定，招商银行因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、未报送权益类投资业务 EAST 数据；五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报，被中国银行保险监督管理委员会罚款 300 万元。

## 2、海通证券（600837）

根据 2021 年 10 月 14 日的行政处罚决定，海通证券作为西南药业股份有限公司（现称“奥瑞德”）重大资产重组并募集配套资金项目独立财务顾问，在执行奥瑞德 2017 年度持续督导过程中，未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注，仅执行了询问及检查“三会”记录、用印记录等程序，未获取当期奥瑞德企业信用报告并保存于奥瑞德持续督导工作底稿中，未对当期奥瑞德企业信用报告进行必要的审阅和查看，导致未能发现奥瑞德违规对外提供担保事项，未能发现奥瑞德相关信息披露存在遗漏。

奥瑞德及其子公司涉及民间借贷事项违法违规，海通证券在奥瑞德已公告公司及子公司涉及借款纠纷被提起诉讼的情况下，未保持合理职业怀疑对奥瑞德涉及的民间借贷事项进行充分核查和验证，仅获取了奥瑞德董事会出具的书面声明等内部证据，未获取相关借款合同、起诉状、法院相关法律文书等外部客观证据，未执行向法院及案件代理律师等第三方进行核查的工作程序，未通过法院庭审公开网等公开渠道检索有关案件信息，导致未能发现奥瑞德未依法披露其相关重大借款合同及实际控制人占用奥瑞德资金等事项。

奥瑞德未将上述借款纠纷所涉及的借贷资金记入财务账簿，其 2017 年度财务报表存在虚假记载，且对相关借款、向控股股东、实际控制人提供资金的关联交易和违规提供对外担保等重大事项均未按法律相关规定履行临时信息披露义务，也未在 2017 年年度报告中披露上述事项。海通证券未充分履行持续督导义务，涉嫌存在未能勤勉尽责情形，在 2018 年 5 月 2 日出具并由奥瑞德在 2018 年 5 月 4 日披露的《2017 年度现场检查报告》和《2017 年度持续督导意见》存在虚假记载。

根据以上情况，中国证券监督管理委员会重庆监管局对海通证券股份有限公司责令改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款。

## 3、浦发银行（600000）

根据 2022 年 3 月 21 日的行政处罚决定，浦发银行因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及

数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、漏报债券投资业务 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、漏报公募基金投资业务 EAST 数据；七、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；八、错报跟单信用证业务 EAST 数据；九、错报保函业务 EAST 数据；十、错报贷款承诺业务 EAST 数据；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十四、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十五、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报，被中国银行保险监督管理委员会罚款 420 万元。

根据 2021 年 7 月 13 日的行政处罚决定，浦发银行因一、监管发现的问题屡查屡犯；二、配合现场检查不力；三、内部控制制度修订不及时；四、信息系统管控有效性不足；五、未向监管部门真实反映业务数据；六、净值型理财产品估值方法使用不准确；七、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；八、理财产品相互交易调节收益；九、使用理财资金偿还本行贷款；十、理财产品发行审批管理不到位；十一、权益类理财产品投资非权益类资产超比例；十二、公募理财产品持有单只证券市值超比例；十三、投资集合资金信托计划人数超限；十四、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；十五、出具与事实不符的理财产品投资清单；十六、私募理财产品销售文件未约定投资者冷静期；十七、投资者投资私募理财产品金额不符合监管要求；十八、理财产品资产配置与产品说明书约定不符；十九、理财产品信息披露不合规；二十、理财产品信息登记不规范；二十一、理财业务流动性风险管理不审慎；二十二、理财投资股票类业务管理不审慎；二十三、同业存款记入其他企业存款核算；二十四、同业投资投后检查流于形式；二十五、风险加权资产计量不准确；二十六、为无衍生品交易资格的机构发行结构性存款提供通道；二十七、结构性存款未实际嵌入金融衍生品；二十八、未落实委托贷款专户管理要求；二十九、借助通道违规发放委托贷款，承担实质性风险；三十、委托贷款投向不合规；三十一、违规向委托贷款借款人收取手续费，被中国银行保险监督管理委员会罚款 6920 万元。

对招商银行（600036）、海通证券（600837）、浦发银行（600000）投资决策程序的说明：

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该处罚事项未对上述机构的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 7.12.3 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	41,800.70
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	134.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,935.50

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
319	94,950.61	28,308,340.19	93.46%	1,980,904.18	6.54%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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（2018年2月7日）基金份额总额	265,609,851.46
本报告期期初基金份额总额	154,184,436.41
本报告期基金总申购份额	7,184,807.50
减：本报告期基金总赎回份额	131,079,999.54
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	30,289,244.37

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

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及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未有受到稽查或处罚的情形。  
本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	169,031,323.85	99.60%	123,612.69	99.60%	-
山西证券	2	686,013.56	0.40%	501.71	0.40%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：



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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：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
东兴证券	45,869.50	100.00%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

### 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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	四大报、指定互联网网站	2022年1月5日
2	诺德基金管理有限公司关于诺德天富灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2022年1月7日
3	诺德天富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2022年1月24日
4	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2022年1月24日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下	四大报、指定互联网	2022年2月18日

	部分基金在玄元保险代理有限公司开通申（认）购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	网站	
6	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华夏财富投资管理有限公司开通申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 2 月 25 日
7	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海中欧财富基金销售有限公司开通申（认）购（含定期定额投资）、赎回、转换业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 3 月 18 日
8	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京创金启富基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 3 月 26 日
9	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 3 月 30 日
10	诺德天富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定互联网网站	2022 年 3 月 30 日
11	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 3 月 30 日
12	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东肯特瑞基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 4 月 9 日
13	诺德天富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2022 年 4 月 22 日
14	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 4 月 22 日
15	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 4 月 22 日
16	诺德基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	四大报、指定互联网网站	2022 年 4 月 28 日
17	诺德基金管理有限公司关于旗下	四大报、指定互联网	2022 年 5 月 20 日

	部分基金在博时财富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	网站	
--	--	----	--

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220217; 20220308-20220310	51,621,170.43	-	51,621,170.43	0.00	0.00%
	3	20220101-20220619	34,219,046.42	-	34,219,046.42	0.00	0.00%
	4	20220419-20220630	14,739,829.01	-	-	14,739,829.01	48.66%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

#### 1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

#### 2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

#### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

### 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、《诺德天富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德天富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、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金 2022 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

2022 年 8 月 31 日