诺德新享灵活配置混合型证券投资基金
2024年中期报告

2024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：交通银行股份有限公司

送出日期：2024年8月30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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 10
§5 托管人报告 10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 10
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 11
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 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 12
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 34
7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 38
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 38
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 38
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 本基金投资股指期货的投资政策 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 投资组合报告附注 39

§8 基金份额持有人信息 40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 40
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情况 40

§9 开放式基金份额变动 40

§10 重大事件揭示 40

10.1 基金份额持有人大会决议 40
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 41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 41
10.4 基金投资策略的改变 41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 41
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 41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
10.8 其他重大事件 42

§11 影响投资者决策的其他重要信息 44

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 44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 44

§12 备查文件目录 44

12.1 备查文件目录 44
12.2 存放地点 44
12.3 查阅方式 44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺德新享
基金主代码	004987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 9 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,395,549.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对各大类资产的动态灵活配置，在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，把握市场投资机会，力求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
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，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邵天婷	方圆
	联系电话	021-68985056	95559
	电子邮箱	tianting.shao@nuodefund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-0009	95559
传真		021-68985121	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		潘福祥	任德奇

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,125,297.65
本期利润	6,660,481.21
加权平均基金份额本期利润	0.2048
本期加权平均净值利润率	13.98%
本期基金份额净值增长率	15.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,268,694.93
期末可供分配基金份额利润	0.1877
期末基金资产净值	51,380,301.93
期末基金份额净值	1.5385
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	87.60%

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 2017 年 8 月 9 日。

3.2 基金净值表现

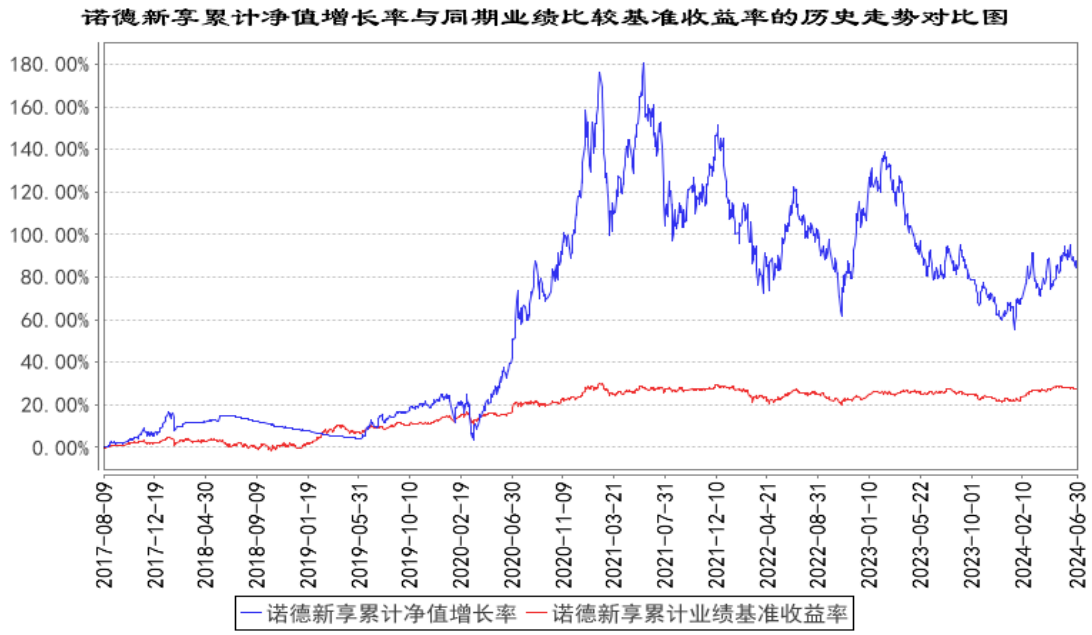
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.72%	1.15%	-0.31%	0.14%	-1.41%	1.01%
过去三个月	7.64%	1.35%	0.73%	0.21%	6.91%	1.14%
过去六个月	15.11%	1.47%	3.38%	0.26%	11.73%	1.21%
过去一年	4.52%	1.30%	1.55%	0.25%	2.97%	1.05%
过去三年	-26.87%	1.71%	-0.32%	0.31%	-26.55%	1.40%
自基金合同生效起至今	87.60%	1.47%	27.45%	0.35%	60.15%	1.12%

注：本基金的业绩比较基准为中证全债指数*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



注：本基金成立于 2017 年 8 月 9 日，图示时间段为 2017 年 8 月 9 日至 2024 年 6 月 30 日。本基金建仓期间自 2017 年 8 月 9 日至 2018 年 2 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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为天府清源控股有限公司和北京天朗云创信息技术有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了四十只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投

资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金、诺德新能源汽车混合型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金、诺德策略回报股票型证券投资基金、诺德兴新趋势混合型证券投资基金、诺德中短债债券型证券投资基金、诺德惠享稳健三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、诺德安承利率债债券型证券投资基金、诺德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

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		
顾钰	本基金基金经理、诺德新宜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的基金经理	2021 年 4 月 2 日	-	13 年	上海大学金融学硕士。2011 年 5 月至 2015 年 11 月任职于恒泰证券股份有限公司，担任研究员职务。2015 年 11 月加入诺德基金管理有限公司，担任研究员职务，具有基金从业资格。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2024 年上半年，上证综指呈现区间震荡行情，最终小幅收跌。从行业角度来看，银行、煤炭和公用事业领涨，综合、计算机和商贸零售领跌。

报告期内，本基金秉承“在控制风险的前提下，坚持长期投资，保持低换手率”的投资风格。在权益投资方面，我们将继续自上而下选择行业，自下而上选择个股，以景气度高、核心竞争力强、估值合理甚至低估的优质公司为主。

2024 年上半年，一方面，我国政府持续推出“稳增长”的经济政策，市场信心逐渐恢复。另一方面，美联储的货币政策影响全球市场的流动性，目前来看降息预期逐渐升温。A 股市场的整体估值已经处于历史相对底部区域，如果宏观经济能够企稳向上，未来 A 股市场也有望迎来盈利和估值双击的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.5385 元，累计净值为 1.9685 元。本报告期份额净值增长率为 15.11%，同期业绩比较基准增长率为 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期来看，我国金融开放和外资流入的趋势或将不变。居民投资可能依旧面临一定程度的“资产荒”，权益市场有望承接居民资产配置的需求。从结构方面来看，中长期我们看好景气度向上的细分行业，如能源、资源、科技、高端制造等行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金曾存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在诺德新享灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应

尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，诺德基金管理有限公司在诺德新享灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由诺德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺德新享灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德新享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	16,977,810.62	5,531,811.82
结算备付金		83,172.28	58,597.20
存出保证金		23,049.61	35,882.29
交易性金融资产	6.4.7.2	47,023,657.00	41,533,023.00
其中：股票投资		47,023,657.00	41,533,023.00
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		877,375.80	-

应收股利		-	-
应收申购款		11,852.37	10,288.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		64,996,917.68	47,169,603.23
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 6 月 30 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,263,153.38	13,911.88
应付赎回款		169,258.48	122,731.97
应付管理人报酬		23,368.21	23,817.08
应付托管费		3,894.72	3,969.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	156,940.96	284,521.24
负债合计		13,616,615.75	448,951.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	33,395,549.49	34,954,672.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	17,984,752.44	11,765,979.39
净资产合计		51,380,301.93	46,720,651.57
负债和净资产总计		64,996,917.68	47,169,603.23

注： 报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.5385 元，基金份额总额 33,395,549.49 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德新享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,876,018.42	-7,937,597.08
1.利息收入		20,713.06	23,852.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,713.06	23,852.11

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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,266,582.75	-6,173,338.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,493,933.35	-6,636,128.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	772,649.40	462,789.40
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	1,535,183.56	-2,033,822.41
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	53,539.05	245,712.05
减：二、营业总支出		215,537.21	309,233.59
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	142,098.16	205,525.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	23,683.01	34,254.17
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	49,756.04	69,454.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,660,481.21	-8,246,830.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,660,481.21	-8,246,830.67

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,660,481.21	-8,246,830.67

6.3 净资产变动表

会计主体：诺德新享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	34,954,672.18	-	11,765,979.39	46,720,651.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	34,954,672.18	-	11,765,979.39	46,720,651.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,559,122.69	-	6,218,773.05	4,659,650.36
（一）、综合收益总额	-	-	6,660,481.21	6,660,481.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,559,122.69	-	-441,708.16	-2,000,830.85
其中：1.基金申购款	11,061,554.46	-	5,486,922.95	16,548,477.41
2.基金赎回款	-12,620,677.15	-	-5,928,631.11	-18,549,308.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	33,395,549.49	-	17,984,752.44	51,380,301.93
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	49,155,565.49	-	35,370,549.78	84,526,115.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	49,155,565.49	-	35,370,549.78	84,526,115.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,837,322.59	-	-18,233,558.32	-31,070,880.91
（一）、综合收益总额	-	-	-8,246,830.67	-8,246,830.67
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,837,322.59	-	-9,986,727.65	-22,824,050.24
其中：1.基金申购款	24,670,041.93	-	20,096,031.03	44,766,072.96
2.基金赎回款	-37,507,364.52	-	-30,082,758.68	-67,590,123.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	36,318,242.90	-	17,136,991.46	53,455,234.36

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

诺德新享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]719 号《关于准予诺德新享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《诺德新享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 204,981,857.55 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 772 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德新享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 204,993,133.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,275.53 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德新享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、银行存款、同业存单、资产支持证券、权证、银行存款、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：中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德新享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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

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

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

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	16,977,810.62
等于：本金	16,974,259.57
加：应计利息	3,551.05
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	16,977,810.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		46,232,991.44	-	47,023,657.00	790,665.56
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		46,232,991.44	-	47,023,657.00	790,665.56

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

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	53.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	107,161.34
其中：交易所市场	107,161.34
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,726.04
合计	156,940.96

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,954,672.18	34,954,672.18
本期申购	11,061,554.46	11,061,554.46
本期赎回（以“-”号填列）	-12,620,677.15	-12,620,677.15
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	33,395,549.49	33,395,549.49

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
上年度末	928,403.12	10,837,576.27	11,765,979.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	928,403.12	10,837,576.27	11,765,979.39
本期利润	5,125,297.65	1,535,183.56	6,660,481.21
本期基金份额交易产生的变动数	214,994.16	-656,702.32	-441,708.16
其中：基金申购款	1,231,540.56	4,255,382.39	5,486,922.95
基金赎回款	-1,016,546.40	-4,912,084.71	-5,928,631.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,268,694.93	11,716,057.51	17,984,752.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,862.89
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	1,404.46
其他	445.71
合计	20,713.06

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	121,957,078.47
减：卖出股票成本总额	117,156,661.26
减：交易费用	306,483.86
买卖股票差价收入	4,493,933.35

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	772,649.40
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	772,649.40

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,535,183.56
股票投资	1,535,183.56
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,535,183.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	51,896.31
基金转换费收入	1,642.74
合计	53,539.05

注：1.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；未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	30.00
合计	49,756.04

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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
天府清源控股有限公司(“天府清控”)	基金管理人的股东
北京天朗云创信息技术有限公司(“天朗云创”)	基金管理人的股东

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

有限公司股权结构变更。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	142,098.16	205,525.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	58,584.59	85,822.89
应支付基金管理人的净管理费	83,513.57	119,702.17

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 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 X 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,683.01	34,254.17

注：支付基金托管人交通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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 8 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	458,043.24	458,043.24
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	458,043.24	458,043.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.37%	1.26%

注：（1）期间买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
交通银行	16,977,810.62	18,862.89	4,619,125.93	21,848.48

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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（2024 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只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、合规稽核部、风险控制部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,977,810.62	-	-	-	-	-	16,977,810.62
结算备付金	83,172.28	-	-	-	-	-	83,172.28
存出保证金	23,049.61	-	-	-	-	-	23,049.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	47,023,657.00	47,023,657.00
应收申购款	-	-	-	-	-	11,852.37	11,852.37
应收清算款	-	-	-	-	-	877,375.80	877,375.80
资产总计	17,084,032.51	-	-	-	-	47,912,885.17	64,996,917.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	169,258.48	169,258.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,368.21	23,368.21
应付托管费	-	-	-	-	-	3,894.72	3,894.72
应付清算款	-	-	-	-	-	13,263,153.38	13,263,153.38
其他负债	-	-	-	-	-	156,940.96	156,940.96
负债总计	-	-	-	-	-	13,616,615.75	13,616,615.75
利率敏感度缺口	17,084,032.51	-	-	-	-	34,296,269.42	51,380,301.93
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,531,811.82	-	-	-	-	-	5,531,811.82
结算备付金	58,597.20	-	-	-	-	-	58,597.20
存出保证金	35,882.29	-	-	-	-	-	35,882.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	41,533,023.00	41,533,023.00
应收申购款	-	-	-	-	-	10,288.92	10,288.92
资产总计	5,626,291.31	-	-	-	-	41,543,311.92	47,169,603.23
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	122,731.97	122,731.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,817.08	23,817.08
应付托管费	-	-	-	-	-	3,969.49	3,969.49
应付清算款	-	-	-	-	-	13,911.88	13,911.88
其他负债	-	-	-	-	-	284,521.24	284,521.24
负债总计	-	-	-	-	-	448,951.66	448,951.66
利率敏感度缺口	5,626,291.31	-	-	-	-	41,094,360.26	46,720,651.57

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 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(2023 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023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	47,023,657.00	91.52	41,533,023.00	88.90
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,023,657.00	91.52	41,533,023.00	88.90

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	1,167,103.56	2,311,737.84
	沪深 300 指数下降 5%	-1,167,103.56	-2,311,737.84

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	47,023,657.00	41,533,023.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	47,023,657.00	41,533,023.00

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 2024 年 06 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（2023 年 06 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	47,023,657.00	72.35

	其中：股票	47,023,657.00	72.35
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	17,060,982.90	26.25
8	其他各项资产	912,277.78	1.40
9	合计	64,996,917.68	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	27,566,470.00	53.65
C	制造业	1,907,607.00	3.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,549,580.00	34.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,023,657.00	91.52

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601699	潞安环能	150,000	2,719,500.00	5.29
2	601898	中煤能源	208,000	2,595,840.00	5.05
3	000983	山西焦煤	251,000	2,587,810.00	5.04
4	601001	晋控煤业	156,000	2,577,120.00	5.02
5	601225	陕西煤业	100,000	2,577,000.00	5.02
6	601088	中国神华	58,000	2,573,460.00	5.01
7	600027	华电国际	350,000	2,429,000.00	4.73
8	600011	华能国际	250,000	2,405,000.00	4.68
9	600795	国电电力	380,000	2,276,200.00	4.43
10	600519	贵州茅台	1,300	1,907,607.00	3.71
11	600642	申能股份	188,000	1,660,040.00	3.23
12	601857	中国石油	156,000	1,609,920.00	3.13
13	600938	中国海油	48,000	1,584,000.00	3.08
14	600028	中国石化	248,000	1,567,360.00	3.05
15	601918	新集能源	160,000	1,560,000.00	3.04
16	600546	山煤国际	105,000	1,535,100.00	2.99
17	600886	国投电力	84,000	1,532,160.00	2.98
18	600025	华能水电	140,000	1,509,200.00	2.94
19	600348	华阳股份	151,000	1,503,960.00	2.93
20	600023	浙能电力	208,000	1,478,880.00	2.88
21	600674	川投能源	77,000	1,443,750.00	2.81
22	000543	皖能电力	163,000	1,442,550.00	2.81
23	002039	黔源电力	78,000	1,372,800.00	2.67
24	600123	兰花科创	144,000	1,288,800.00	2.51
25	601101	昊华能源	140,000	1,286,600.00	2.50

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	600027	华电国际	6,416,774.00	13.73
2	600011	华能国际	6,370,369.00	13.64
3	600395	盘江股份	4,978,017.00	10.65
4	600348	华阳股份	4,940,492.50	10.57
5	601918	新集能源	4,919,206.00	10.53

6	601666	平煤股份	4,903,428.00	10.50
7	002128	电投能源	4,886,586.00	10.46
8	600508	上海能源	4,793,564.00	10.26
9	600642	申能股份	4,790,248.00	10.25
10	600795	国电电力	4,592,428.00	9.83
11	600023	浙能电力	4,484,828.00	9.60
12	000543	皖能电力	4,476,806.00	9.58
13	601225	陕西煤业	4,474,392.00	9.58
14	600519	贵州茅台	4,123,533.00	8.83
15	600028	中国石化	3,974,102.00	8.51
16	601857	中国石油	3,856,272.00	8.25
17	600938	中国海油	3,848,328.00	8.24
18	601101	昊华能源	3,439,266.00	7.36
19	601088	中国神华	3,129,340.00	6.70
20	601898	中煤能源	3,123,390.00	6.69
21	600546	山煤国际	2,597,396.00	5.56
22	600809	山西汾酒	2,381,479.00	5.10
23	000568	泸州老窖	2,375,673.00	5.08
24	600971	恒源煤电	2,347,643.00	5.02
25	600483	福能股份	2,346,184.20	5.02
26	603369	今世缘	2,311,565.00	4.95
27	600123	兰花科创	2,300,720.00	4.92
28	000596	古井贡酒	2,289,548.00	4.90
29	600863	内蒙华电	2,141,063.00	4.58
30	601699	潞安环能	1,553,262.00	3.32
31	600886	国投电力	1,526,976.00	3.27
32	600025	华能水电	1,509,066.00	3.23
33	600674	川投能源	1,410,123.00	3.02
34	002039	黔源电力	1,363,633.00	2.92
35	601001	晋控煤业	1,143,698.00	2.45

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	601666	平煤股份	7,486,890.00	16.02
2	603369	今世缘	6,023,162.18	12.89
3	000596	古井贡酒	6,012,630.69	12.87
4	000568	泸州老窖	5,999,525.00	12.84
5	600809	山西汾酒	5,991,087.84	12.82
6	600519	贵州茅台	5,916,711.80	12.66
7	002128	电投能源	5,457,758.63	11.68
8	600395	盘江股份	5,008,017.27	10.72

9	600508	上海能源	4,761,748.00	10.19
10	600027	华电国际	4,607,126.63	9.86
11	600011	华能国际	4,346,523.75	9.30
12	601918	新集能源	4,049,584.97	8.67
13	600348	华阳股份	3,602,397.78	7.71
14	601898	中煤能源	3,493,050.70	7.48
15	603198	迎驾贡酒	3,470,365.11	7.43
16	600642	申能股份	3,416,155.00	7.31
17	600023	浙能电力	3,393,529.00	7.26
18	000543	皖能电力	3,392,642.00	7.26
19	600256	广汇能源	2,903,525.00	6.21
20	600795	国电电力	2,745,422.00	5.88
21	601101	昊华能源	2,663,760.63	5.70
22	600985	淮北矿业	2,569,203.52	5.50
23	601225	陕西煤业	2,379,016.48	5.09
24	600028	中国石化	2,364,389.00	5.06
25	600483	福能股份	2,340,775.22	5.01
26	600938	中国海油	2,314,082.00	4.95
27	601857	中国石油	2,231,934.00	4.78
28	600971	恒源煤电	2,169,114.90	4.64
29	601699	潞安环能	2,156,733.99	4.62
30	600863	内蒙华电	2,143,417.00	4.59
31	000983	山西焦煤	2,131,268.74	4.56
32	601001	晋控煤业	1,672,979.04	3.58
33	600546	山煤国际	945,554.00	2.02

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

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	121,112,111.70
卖出股票收入（成交）总额	121,957,078.47

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

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	23,049.61
2	应收清算款	877,375.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,852.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	912,277.78

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（%）
14,261	2,341.74	4,399,567.55	13.17	28,995,981.94	86.83

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	24,254.89	0.07

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 8 月 9 日）基金份额总额	204,993,133.08
本报告期期初基金份额总额	34,954,672.18
本报告期基金总申购份额	11,061,554.46
减：本报告期基金总赎回份额	12,620,677.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,395,549.49

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）本基金管理人 2024 年 6 月 29 日发布公告，陈培阳先生自 2024 年 6 月 28 日起离任公司督察长职务，总经理罗凯先生代任督察长一职。

（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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人；相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 5 月 21 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令整改；警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已按要求及时改正并提交整改报告
其他	-

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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(%)	
海通证券	2	243,069,190.17	100.00	229,919.91	100.00	-
东海证券	2	-	-	-	-	-

国金证券	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(%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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公司实际控制人变更的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 1 月 11 日
2	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）、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 1 月 19 日
3	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 1 月 19 日

4	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2024 年 1 月 19 日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海大智慧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	2024 年 2 月 28 日
6	诺德基金管理有限公司关于关闭公司直销网上交易平台、微信交易平台（诺德基金微理财）开户、认购、申购（含定期定额投资）、基金转换业务的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 3 月 1 日
7	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 3 月 14 日
8	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险代理有限公司申购（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	2024 年 3 月 14 日
9	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 3 月 28 日
10	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	指定互联网网站	2024 年 3 月 28 日
11	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 4 月 12 日
12	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 4 月 19 日
13	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2024 年 4 月 19 日
14	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）、转换业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 5 月 31 日
15	诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金基金产品资料概要更新提示性公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 6 月 27 日
16	诺德新享灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定互联网网站	2024 年 6 月 27 日
17	诺德基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 6 月 29 日
18	诺德基金管理有限公司关于董事变更的公告	四大报、指定互联网网站	2024 年 6 月 29 日

19	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京新浪仓石基金销售有限公司有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、指定互联网网站	2024 年 6 月 29 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《诺德新享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德新享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、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金 2024 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

2024 年 8 月 30 日