

诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
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	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 盈利投资者数量占比	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	诺德量化核心	
基金主代码	006267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日	
基金管理人	诺德基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,408,584.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺德量化核心 A	诺德量化核心 C
下属分级基金的交易代码	006267	006268
报告期末下属分级基金的份额总额	49,389,329.14 份	22,019,255.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化基本面策略精选上市公司，构建核心股票池，根据个股择时策略动态调整核心股票池中个股的仓位，并用数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值，为投资人带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金通过量化基本面方法，“自上而下”与“自下而上”相结合，对经济情况、公司基本面、估值水平等情况进行深入分析研究，精选投资标的，构建投资组合。同时，对市场情绪、市场交易行为等方面进行分析研究，对市场走势及个股价格走势进行合理预判，动态调整投资组合中个股的仓位，进行积极的组合管理与风险控制，力争实现基金资产的长期增值及稳健的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邵天婷	王茵
	联系电话	021-68985056	010-63639180
	电子邮箱	tianting.shao@nuodefund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-888-0009	95595
传真		021-68985121	010-63639132

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	郑成武	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	诺德量化核心 A	诺德量化核心 C
本期已实现收益	6,544,421.18	3,006,826.20
本期利润	3,244,853.25	1,552,264.77
加权平均基金份额 本期利润	0.0561	0.0570
本期加权平均净 值利润率	3.60%	3.68%
本期基金份额净 值增长率	2.57%	2.52%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	13,632,863.19	5,820,101.77
期末可供分配基 金份额利润	0.2760	0.2643
期末基金资产净 值	73,980,893.20	32,731,328.58

期末基金份额净值	1.4979	1.4865
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	56.83%	55.64%

- 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 11 月 22 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺德量化核心 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.72%	1.41%	7.66%	0.76%	-6.94%	0.65%
过去六个月	2.57%	1.37%	5.56%	0.68%	-2.99%	0.69%
过去一年	22.41%	1.11%	16.26%	0.61%	6.15%	0.50%
过去三年	41.20%	1.48%	24.65%	0.66%	16.55%	0.82%
过去五年	-24.47%	1.38%	8.53%	0.66%	-33.00%	0.72%
过去七年	39.39%	1.43%	36.48%	0.69%	2.91%	0.74%
自基金合同生效起至今	56.83%	1.41%	53.57%	0.71%	3.26%	0.70%

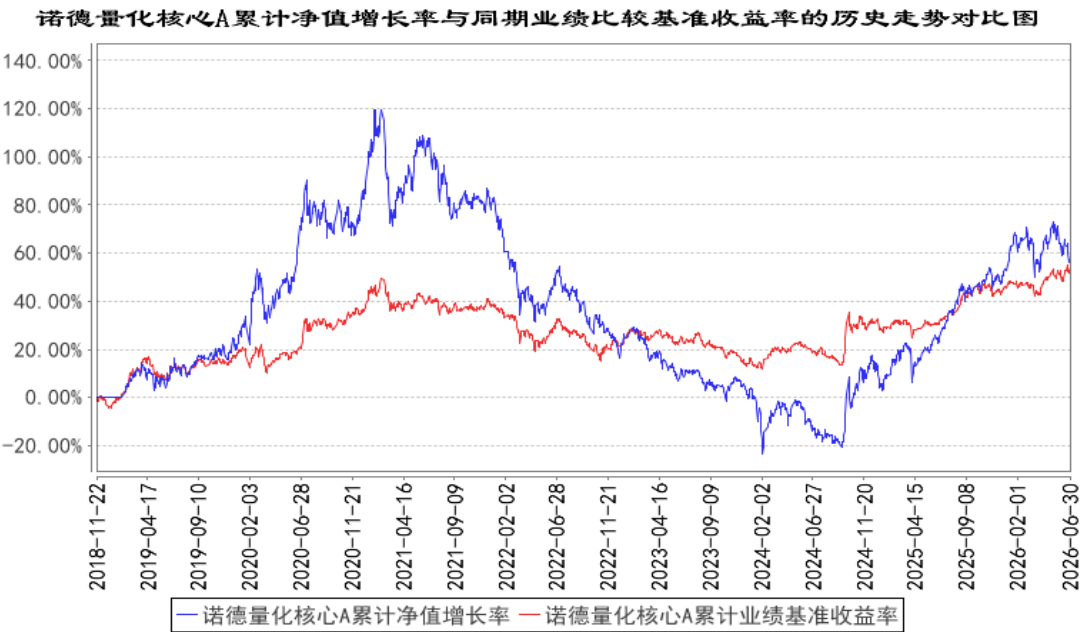
诺德量化核心 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

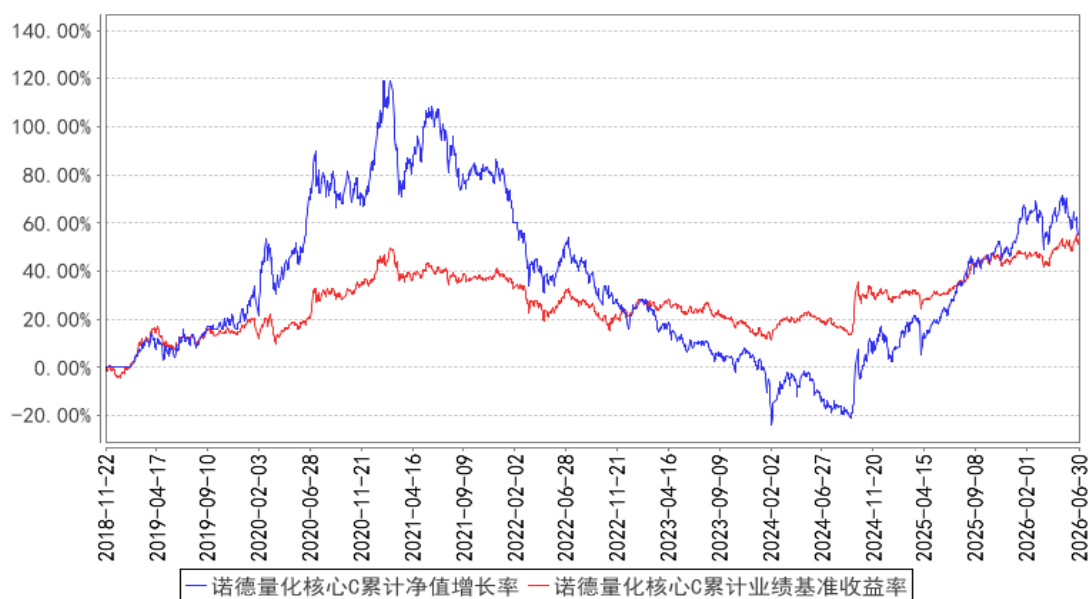
过去三个月	0.70%	1.41%	7.66%	0.76%	-6.96%	0.65%
过去六个月	2.52%	1.37%	5.56%	0.68%	-3.04%	0.69%
过去一年	22.29%	1.11%	16.26%	0.61%	6.03%	0.50%
过去三年	40.78%	1.48%	24.65%	0.66%	16.13%	0.82%
过去五年	-24.84%	1.38%	8.53%	0.66%	-33.37%	0.72%
过去七年	38.42%	1.43%	36.48%	0.69%	1.94%	0.74%
自基金合同生效 起至今	55.64%	1.41%	53.57%	0.71%	2.07%	0.70%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%。

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



诺德量化核心C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2018 年 11 月 22 日，图示时间段为 2018 年 11 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日。

本基金建仓期间自 2018 年 11 月 22 日至 2019 年 5 月 21 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为天府清源控股有限公司和北京天朗云创信息技术有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了四十四只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有

期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金、诺德新能源汽车混合型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金、诺德策略回报股票型证券投资基金、诺德兴新趋势混合型证券投资基金、诺德中短债债券型证券投资基金、诺德惠享稳健三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、诺德安承利率债债券型证券投资基金、诺德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、诺德安锦利率债债券型证券投资基金、诺德安悦债券型证券投资基金、诺德丰景 90 天持有期债券型证券投资基金、诺德华证价值优选 50 指数型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王恒楠	本基金基金经理、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、诺德华证价值 50 指数型发起式证券投资基金的基金经理、量化投资部总监	2018 年 11 月 22 日	-	15 年	英国约克大学数学金融硕士，曾经任职于华商基金管理有限公司。2012 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，历任助理研究员、量化策略研究员、专户投资部总监、量化事业部总监、量化投资部总监等职务，具有基金从业资格。

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场表现相对活跃，整体处于上涨行情中。四月份整体上涨趋势较明显，而后出现愈加明显的板块分化，科技板块持续走高，而部分其他板块开始震荡下行。AI 相关板块在 2026 年上半年获得了相对不错的收益。进入 2026 年三季度，随着定期报告的陆续披露，产业机会较大的板块以及估值见底的板块，有望在基本面数据的催化下演绎出行情；同时，市场的活跃度以及板块间的轮动对于流动性的边际变化比较敏感，需要密切关注。

本基金主要围绕高性价比个股进行配置，仓位维持在中高水平。市值风格上偏向中小市值，行业层面保持分散配置。同时，结合个股的波动特征与交易结构变化，适度捕捉交易型机会。整

体来看，本基金坚持在高性价比方向上的配置主线，布局较为分散，市值风格偏小，力求在控制波动的基础上实现稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，诺德量化核心 A 份额净值为 1.4979 元，累计净值为 1.5479 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准收益率为 5.56%。诺德量化核心 C 份额净值为 1.4865 元，累计净值为 1.5365 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.52%，同期业绩比较基准收益率为 5.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，随着半年报数据不断披露、部分估值受到压制个股有望迎来反弹、股市板块间差异有望修复。而产业政策的持续性有望持续利好股市中特定板块与主题。总体而言，大量高性价比个股以及新兴产业的核心个股都可能存在较大上涨空间，基本面趋势强劲个股及优质高性价比个股或具备阶段性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金（以

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限, 根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核, 认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,650,870.67	10,206,760.16
结算备付金		846,264.16	647,650.32
存出保证金		50,744.22	26,375.45
交易性金融资产	6.4.7.2	100,542,205.72	125,054,128.59
其中：股票投资		100,542,205.72	125,054,128.59
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		-	11,381,922.45
应收股利		-	-
应收申购款		365,604.00	75,714.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		108,455,688.77	147,392,551.06
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	10,381,853.39
应付赎回款		1,147,663.86	2,419,004.47
应付管理人报酬		115,797.64	139,216.41
应付托管费		19,299.60	23,202.78
应付销售服务费		2,903.73	3,708.10
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	457,802.16	396,572.63
负债合计		1,743,466.99	13,363,557.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	71,408,584.98	91,983,807.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	35,303,636.80	42,045,185.76
净资产合计		106,712,221.78	134,028,993.28
负债和净资产总计		108,455,688.77	147,392,551.06

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 71,408,584.98 份，其中诺德量化核心 A 类基金份额净值 1.4979 元，基金份额 49,389,329.14 份；诺德量化核心 C 类基金份额净值 1.4865

元，基金份额 22,019,255.84 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,834,167.80	18,593,077.63
1. 利息收入		18,671.64	23,314.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,671.64	23,314.12
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）		10,415,099.15	12,553,126.21
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,614,040.40	11,518,226.81
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	801,058.75	1,034,899.40
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	-4,754,129.36	5,991,019.72
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.21	154,526.37	25,617.58
减：二、营业总支出		1,037,049.78	905,184.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	789,230.12	678,031.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,538.28	113,005.25

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	20,958.52	15,887.00
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	95,322.86	98,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,797,118.02	17,687,893.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,797,118.02	17,687,893.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,797,118.02	17,687,893.52

6.3 净资产变动表

会计主体：诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	91,983,807.52	-	42,045,185.76	134,028,993.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	91,983,807.52	-	42,045,185.76	134,028,993.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-20,575,222.54	-	-6,741,548.96	-27,316,771.50
(一)、综合收益总额	-	-	4,797,118.02	4,797,118.02
(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)	-20,575,222.54	-	-11,538,666.98	-32,113,889.52

其中：1. 基金申购款	22,864,030.78	-	12,890,286.85	35,754,317.63
2. 基金赎回款	-43,439,253.32	-	-24,428,953.83	-67,868,207.15
（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	71,408,584.98	-	35,303,636.80	106,712,221.78
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	105,801,996.41	-	4,893,016.73	110,695,013.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	105,801,996.41	-	4,893,016.73	110,695,013.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,414,697.26	-	17,337,518.26	11,922,821.00
（一）、综合收益总额	-	-	17,687,893.52	17,687,893.52
（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）	-5,414,697.26	-	-350,375.26	-5,765,072.52
其中：1. 基金申购款	7,040,091.41	-	892,080.81	7,932,172.22
2. 基金赎回款	-12,454,788.67	-	-1,242,456.07	-13,697,244.74
（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	100,387,299.15	-	22,230,534.99	122,617,834.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘翔

基金管理人负责人

刘翔

主管会计工作负责人

高奇

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德量化核心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[2018]1170 号《关于准予诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 430,362,905.42 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 0733 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 430,389,212.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,307.44 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化核心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、可交换债券、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、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、权证、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,650,870.67
等于：本金	6,649,945.47
加：应计利息	925.20
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	6,650,870.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	105,256,038.59	-	100,542,205.72	-4,713,832.87
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		105,256,038.59	-	100,542,205.72	-4,713,832.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	371,466.24
其中：交易所市场	371,466.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,322.86
合计	457,802.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

诺德量化核心 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,831,593.47	62,831,593.47
本期申购	11,293,555.81	11,293,555.81
本期赎回（以“-”号填列）	-24,735,820.14	-24,735,820.14
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	49,389,329.14	49,389,329.14

诺德量化核心 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,152,214.05	29,152,214.05
本期申购	11,570,474.97	11,570,474.97

本期赎回（以“-”号填列）	-18,703,433.18	-18,703,433.18
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	22,019,255.84	22,019,255.84

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

不适用。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

诺德量化核心 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,756,309.39	18,171,078.07	28,927,387.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,756,309.39	18,171,078.07	28,927,387.46
本期利润	6,544,421.18	-3,299,567.93	3,244,853.25
本期基金份额交易产生的变动数	-3,667,867.38	-3,912,809.27	-7,580,676.65
其中：基金申购款	3,052,546.13	3,463,249.19	6,515,795.32
基金赎回款	-6,720,413.51	-7,376,058.46	-14,096,471.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,632,863.19	10,958,700.87	24,591,564.06

诺德量化核心 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,693,734.75	8,424,063.55	13,117,798.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,693,734.75	8,424,063.55	13,117,798.30
本期利润	3,006,826.20	-1,454,561.43	1,552,264.77
本期基金份额交易产生的变动数	-1,880,459.18	-2,077,531.15	-3,957,990.33
其中：基金申购款	2,808,207.08	3,566,284.45	6,374,491.53
基金赎回款	-4,688,666.26	-5,643,815.60	-10,332,481.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,820,101.77	4,891,970.97	10,712,072.74

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,366.95
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	1,238.40
其他	66.29
合计	18,671.64

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	644,261,243.77
减：卖出股票成本总额	633,696,022.92
减：交易费用	951,180.45
买卖股票差价收入	9,614,040.40

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	801,058.75
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	801,058.75

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,754,129.36
股票投资	-4,754,129.36
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	-4,754,129.36

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	72,988.60
基金转换费收入	81,537.77
合计	154,526.37

- 注：1. 本基金 A 类基金份额赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对持续持有基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入基金财产；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. 本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。
3. 本基金的转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00
合计	95,322.86

6.4.7.24 分部报告

不适用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
天府清源控股有限公司（“天府清控”）	基金管理人的股东
北京天朗云创信息技术有限公司（“天朗云创”）	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据诺德基金管理有限公司于 2026 年 1 月 5 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会证监许可(2025)2968 号文核准，诺德基金管理有限公司实际控制人变更为四川能源发展集团有限责任公司。本次实际控制人变更不涉及诺德基金管理有限公司注册资本变更、不涉及诺德基金管理有限公司股权结构变更。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	789,230.12	678,031.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	323,759.45	272,681.59
应支付基金管理人的净管理费	465,470.67	405,350.12

注：支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,538.28	113,005.25

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化核心 A	诺德量化核心 C	合计
诺德基金	-	-	-
中国光大银行	-	15,953.29	15,953.29
合计	-	15,953.29	15,953.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺德量化核心 A	诺德量化核心 C	合计

诺德基金	-	-	-
中国光大银行	-	13,690.45	13,690.45
合计	-	13,690.45	13,690.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给诺德基金，再由诺德基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 x 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	6,650,870.67	17,366.95	6,959,188.82	22,331.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	453	3,542.46	9,395.22	—
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	42	771.96	704.76	—
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	85	2,266.10	4,331.60	—
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	45	2,610.00	5,047.20	—
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	113	7,871.58	18,086.78	—
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	69	1,702.92	5,989.20	—
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	56	882.56	2,615.76	—
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	55	2,253.90	16,950.45	—
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	46	2,049.76	21,558.82	—

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。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之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	6,650,870.67	-	-	-	-	-	6,650,870.67
结算备付金	846,264.16	-	-	-	-	-	846,264.16
存出保证金	50,744.22	-	-	-	-	-	50,744.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-	100,542,205.72	100,542,205.72
应收申购款	-	-	-	-	-	365,604.00	365,604.00
资产总计	7,547,879.05	-	-	-	-	100,907,809.72	108,455,688.77

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,147,663.86	1,147,663.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	115,797.64	115,797.64
应付托管费	-	-	-	-	-	19,299.60	19,299.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,903.73	2,903.73
其他负债	-	-	-	-	-	457,802.16	457,802.16
负债总计	-	-	-	-	-	1,743,466.99	1,743,466.99
利率敏感度缺口	7,547,879.05	-	-	-	-	99,164,342.73	106,712,221.78
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,206,760.16	-	-	-	-	-	10,206,760.16
结算备付金	647,650.32	-	-	-	-	-	647,650.32
存出保证金	26,375.45	-	-	-	-	-	26,375.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,054,128.59	125,054,128.59
应收申购款	-	-	-	-	-	75,714.09	75,714.09
应收清算款	-	-	-	-	-	11,381,922.45	11,381,922.45
资产总计	10,880,785.93	-	-	-	-	136,511,765.13	147,392,551.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,419,004.47	2,419,004.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	139,216.41	139,216.41
应付托管费	-	-	-	-	-	23,202.78	23,202.78
应付清算款	-	-	-	-	-	10,381,853.39	10,381,853.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,708.10	3,708.10
其他负债	-	-	-	-	-	396,572.63	396,572.63
负债总计	-	-	-	-	-	13,363,557.78	13,363,557.78
利率敏感度缺口	10,880,785.93	-	-	-	-	123,148,207.35	134,028,993.28

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

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	100,542,205.72	94.22	125,054,128.59	93.30
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	100,542,205.72	94.22	125,054,128.59	93.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,985,488.52	6,530,562.70
	沪深 300 指数下降 5%	-5,985,488.52	-6,530,562.70

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	100,457,525.93	125,054,128.59
第二层次	－	－
第三层次	84,679.79	－

合计	100,542,205.72	125,054,128.59
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,542,205.72	92.70
	其中：股票	100,542,205.72	92.70
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	7,497,134.83	6.91
8	其他各项资产	416,348.22	0.38

9	合计	108,455,688.77	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	137,706.00	0.13
B	采矿业	1,846,385.78	1.73
C	制造业	61,946,449.41	58.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	915,504.64	0.86
E	建筑业	762,571.00	0.71
F	批发和零售业	10,685,763.74	10.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,025,280.84	3.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,447,931.10	6.98
J	金融业	4,136,569.50	3.88
K	房地产业	1,212,287.52	1.14
L	租赁和商务服务业	2,815,879.20	2.64
M	科学研究和技术服务业	1,661,882.69	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	1,983,659.00	1.86
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	964,335.30	0.90
S	综合	-	-
	合计	100,542,205.72	94.22

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	002275	桂林三金	200,400	2,442,876.00	2.29
2	002727	一心堂	218,519	2,095,597.21	1.96
3	600269	赣粤高速	471,458	1,876,402.84	1.76
4	688093	世华科技	47,646	1,758,137.40	1.65
5	603368	柳药集团	117,000	1,716,390.00	1.61

6	003020	立方制药	100,420	1,487,220.20	1.39
7	600335	国机汽车	301,354	1,410,336.72	1.32
8	600987	航民股份	230,549	1,394,821.45	1.31
9	002111	威海广泰	152,200	1,369,800.00	1.28
10	600267	海正药业	134,779	1,362,615.69	1.28
11	000028	国药一致	70,960	1,341,853.60	1.26
12	688687	凯因科技	81,725	1,332,934.75	1.25
13	002884	凌霄泵业	86,372	1,316,309.28	1.23
14	688389	普门科技	133,138	1,303,421.02	1.22
15	600861	北京人力	104,800	1,278,560.00	1.20
16	600351	亚宝药业	221,100	1,271,325.00	1.19
17	300226	上海钢联	82,520	1,263,381.20	1.18
18	003012	东鹏控股	287,500	1,253,500.00	1.17
19	603566	普莱柯	128,000	1,253,120.00	1.17
20	000885	城发环境	103,678	1,247,246.34	1.17
21	002543	万和电气	199,787	1,242,675.14	1.16
22	688416	恒烁股份	8,841	1,237,740.00	1.16
23	603018	华设集团	239,040	1,228,665.60	1.15
24	300232	洲明科技	213,309	1,222,260.57	1.15
25	600738	丽尚国潮	338,867	1,219,921.20	1.14
26	000507	珠海港	258,600	1,210,248.00	1.13
27	603680	今创集团	122,921	1,205,855.01	1.13
28	688232	新点软件	67,734	1,204,310.52	1.13
29	002483	润邦股份	240,220	1,186,686.80	1.11
30	300194	福安药业	334,500	1,130,610.00	1.06
31	601398	工商银行	147,602	1,043,546.14	0.98
32	601988	中国银行	182,223	1,042,315.56	0.98
33	601939	建设银行	107,533	1,035,542.79	0.97
34	601288	农业银行	167,243	1,015,165.01	0.95
35	688279	峰岬科技	4,505	1,011,102.20	0.95
36	301559	中集环科	82,942	1,011,062.98	0.95
37	000915	华特达因	34,900	988,019.00	0.93
38	600320	振华重工	238,200	983,766.00	0.92
39	300389	艾比森	75,660	969,961.20	0.91
40	603111	康尼机电	171,185	968,907.10	0.91
41	600742	富维股份	133,236	964,628.64	0.90
42	600223	福瑞达	190,200	956,706.00	0.90
43	600033	福建高速	291,500	938,630.00	0.88
44	600639	浦东金桥	102,221	932,255.52	0.87
45	600508	上海能源	125,200	922,724.00	0.86
46	601121	宝地矿业	162,104	914,266.56	0.86
47	002745	木林森	72,800	913,640.00	0.86
48	300271	华宇软件	186,000	896,520.00	0.84

49	002991	甘源食品	22,665	895,494.15	0.84
50	000948	南天信息	75,300	895,317.00	0.84
51	002649	博彦科技	109,100	888,074.00	0.83
52	002643	万润股份	42,000	879,900.00	0.82
53	603013	亚普股份	55,608	878,050.32	0.82
54	300354	东华测试	25,800	874,104.00	0.82
55	300613	富瀚微	10,700	856,856.00	0.80
56	002376	新北洋	147,830	850,022.50	0.80
57	688049	炬芯科技	17,476	819,799.16	0.77
58	002876	三利谱	23,200	816,872.00	0.77
59	688023	安恒信息	22,051	809,712.72	0.76
60	600894	广日股份	104,993	800,046.66	0.75
61	688230	芯导科技	10,130	798,345.30	0.75
62	688533	上声电子	38,162	796,059.32	0.75
63	000576	甘化科工	118,600	779,202.00	0.73
64	000589	贵州轮胎	187,500	761,250.00	0.71
65	600218	全柴动力	101,800	734,996.00	0.69
66	300833	浩洋股份	24,027	725,134.86	0.68
67	603611	诺力股份	42,774	692,511.06	0.65
68	002933	新兴装备	25,700	664,345.00	0.62
69	600300	维维股份	227,300	640,986.00	0.60
70	603053	成都燃气	76,624	640,576.64	0.60
71	600694	大商股份	47,600	629,748.00	0.59
72	002061	浙江交科	190,500	628,650.00	0.59
73	603273	天元智能	48,400	626,780.00	0.59
74	300729	乐歌股份	64,920	624,530.40	0.59
75	688526	科前生物	51,247	620,088.70	0.58
76	000555	神州信息	59,800	615,940.00	0.58
77	300388	节能国祯	97,235	599,939.95	0.56
78	002614	奥佳华	132,042	583,625.64	0.55
79	002758	浙农股份	53,100	419,490.00	0.39
80	300183	东软载波	39,747	415,356.15	0.39
81	002540	亚太科技	85,319	398,439.73	0.37
82	601311	骆驼股份	49,686	387,053.94	0.36
83	002441	众业达	49,558	386,552.40	0.36
84	600551	时代出版	56,600	376,390.00	0.35
85	002533	金杯电工	29,600	315,832.00	0.30
86	002666	德联集团	75,182	296,968.90	0.28
87	000049	德赛电池	11,619	271,536.03	0.25
88	605577	龙版传媒	30,734	270,766.54	0.25
89	002233	塔牌集团	38,241	266,539.77	0.25
90	000612	焦作万方	23,109	244,724.31	0.23
91	002953	日丰股份	27,600	240,672.00	0.23

92	002588	史丹利	29,400	232,260.00	0.22
93	300213	佳讯飞鸿	36,300	219,978.00	0.21
94	600273	嘉化能源	33,700	219,724.00	0.21
95	002276	万马股份	20,401	206,254.11	0.19
96	002206	海利得	39,600	204,732.00	0.19
97	603312	西典新能	6,000	203,880.00	0.19
98	600595	中孚实业	36,022	202,443.64	0.19
99	301456	盘古智能	8,800	198,704.00	0.19
100	002274	华昌化工	41,388	191,626.44	0.18
101	002396	星网锐捷	9,962	190,971.54	0.18
102	601801	皖新传媒	37,894	186,817.42	0.18
103	688670	金迪克	9,943	168,434.42	0.16
104	688265	南模生物	4,552	157,453.68	0.15
105	002521	齐峰新材	20,400	147,696.00	0.14
106	688137	近岸蛋白	4,084	147,024.00	0.14
107	002593	日上集团	36,200	144,438.00	0.14
108	002381	双箭股份	27,673	143,346.14	0.13
109	002889	东方嘉盛	13,700	141,932.00	0.13
110	000897	津滨发展	84,900	140,934.00	0.13
111	301019	宁波色母	7,900	140,857.00	0.13
112	688244	永信至诚	9,789	139,591.14	0.13
113	605169	洪通燃气	15,700	139,573.00	0.13
114	002722	物产金轮	11,800	139,122.00	0.13
115	002133	广宇集团	58,200	139,098.00	0.13
116	300439	美康生物	17,300	138,919.00	0.13
117	603237	五芳斋	11,200	138,656.00	0.13
118	300915	海融科技	7,000	138,600.00	0.13
119	300823	建科智能	9,500	138,510.00	0.13
120	603982	泉峰汽车	24,700	138,073.00	0.13
121	600051	宁波联合	24,500	137,935.00	0.13
122	600148	长春一东	9,500	137,845.00	0.13
123	002391	长青股份	28,300	137,821.00	0.13
124	000570	苏常柴A	29,500	137,765.00	0.13
125	600097	开创国际	17,700	137,706.00	0.13
126	002863	今飞凯达	32,400	137,376.00	0.13
127	603107	上海汽配	12,100	137,335.00	0.13
128	301166	优宁维	5,323	137,280.17	0.13
129	603086	先达股份	26,400	137,016.00	0.13
130	603041	美思德	13,200	136,884.00	0.13
131	301370	国科恒泰	16,900	136,721.00	0.13
132	603102	百合股份	4,325	136,540.25	0.13
133	688466	金科环境	10,637	136,472.71	0.13
134	301088	戎美股份	11,900	136,374.00	0.13

135	605266	健之佳	9,300	136,152.00	0.13
136	600697	欧亚集团	14,000	136,080.00	0.13
137	301296	新巨丰	23,100	135,828.00	0.13
138	688217	睿昂基因	6,571	135,756.86	0.13
139	688616	西力科技	13,434	135,683.40	0.13
140	688420	美腾科技	6,439	135,669.73	0.13
141	600419	天润乳业	17,914	135,608.98	0.13
142	300800	力合科技	14,647	135,484.75	0.13
143	000605	渤海股份	25,300	135,355.00	0.13
144	300625	三雄极光	14,900	135,292.00	0.13
145	603385	惠达卫浴	27,700	135,176.00	0.13
146	300512	中亚股份	19,800	135,036.00	0.13
147	301032	新柴股份	14,500	134,850.00	0.13
148	603810	丰山集团	12,100	134,673.00	0.13
149	000529	广弘控股	31,600	134,616.00	0.13
150	600613	神奇制药	30,307	134,563.08	0.13
151	603214	爱婴室	11,100	134,421.00	0.13
152	603518	锦泓集团	18,800	134,420.00	0.13
153	688285	高铁电气	18,685	133,971.45	0.13
154	603909	建发合诚	15,700	133,921.00	0.13
155	301173	毓恬冠佳	4,500	133,695.00	0.13
156	301100	风光股份	9,600	133,440.00	0.13
157	002942	新农股份	9,300	133,269.00	0.12
158	688067	爱威科技	6,612	133,231.80	0.12
159	301190	善水科技	8,300	133,049.00	0.12
160	603151	邦基科技	12,100	132,979.00	0.12
161	002144	宏达高科	13,500	132,975.00	0.12
162	301258	富士莱	5,839	132,954.03	0.12
163	000419	通程控股	29,445	132,796.95	0.12
164	605001	威奥股份	24,348	132,696.60	0.12
165	002566	益盛药业	21,900	132,276.00	0.12
166	603329	上海雅仕	14,700	132,006.00	0.12
167	603089	正裕工业	15,800	131,930.00	0.12
168	600356	恒丰纸业	17,800	131,898.00	0.12
169	688393	安必平	7,382	131,251.96	0.12
170	603321	梅轮电梯	22,900	130,988.00	0.12
171	002022	科华生物	28,550	130,759.00	0.12
172	688060	云涌科技	3,968	130,507.52	0.12
173	603096	新经典	9,743	130,361.34	0.12
174	301332	德尔玛	17,000	130,050.00	0.12
175	603900	莱绅通灵	23,054	129,794.02	0.12
176	301469	恒达新材	4,700	129,626.00	0.12
177	001231	农心科技	7,100	129,504.00	0.12

178	003016	欣贺股份	21,100	129,343.00	0.12
179	001222	源飞宠物	9,700	128,816.00	0.12
180	300732	设研院	23,113	128,739.41	0.12
181	000619	海螺新材	29,100	128,040.00	0.12
182	688560	明冠新材	10,778	127,719.30	0.12
183	001368	通达创智	6,193	127,390.01	0.12
184	603192	汇得科技	7,500	127,050.00	0.12
185	002574	明牌珠宝	30,602	126,998.30	0.12
186	600128	苏豪弘业	16,630	126,221.70	0.12
187	603180	金牌家居	9,152	125,565.44	0.12
188	603970	中农立华	12,679	122,098.77	0.11
189	603205	健尔康	5,897	120,652.62	0.11
190	002551	尚荣医疗	45,047	120,275.49	0.11
191	002763	汇洁股份	17,379	118,003.41	0.11
192	688021	奥福科技	5,911	114,436.96	0.11
193	688797	臻宝科技	46	21,558.82	0.02
194	301682	宏明电子	113	18,086.78	0.02
195	688635	长进光子	55	16,950.45	0.02
196	001257	盛龙股份	453	9,395.22	0.01
197	301696	三瑞智能	69	5,989.20	0.01
198	301680	固德电材	45	5,047.20	0.00
199	301513	尚水智能	85	4,331.60	0.00
200	603435	嘉德利	56	2,615.76	0.00
201	001312	福恩股份	42	704.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688416	恒烁股份	3,527,191.16	2.63
2	601939	建设银行	3,386,323.00	2.53
3	601988	中国银行	3,379,725.00	2.52
4	601398	工商银行	3,379,237.00	2.52
5	601288	农业银行	3,288,396.00	2.45
6	002396	星网锐捷	2,952,138.20	2.20
7	002275	桂林三金	2,938,668.71	2.19
8	688093	世华科技	2,822,044.25	2.11
9	600025	华能水电	2,815,872.00	2.10
10	600886	国投电力	2,815,683.00	2.10
11	600900	长江电力	2,814,671.00	2.10
12	002884	凌霄泵业	2,745,179.00	2.05
13	301215	中汽股份	2,643,100.00	1.97
14	600861	北京人力	2,587,800.00	1.93

15	301051	信濠光电	2,499,899.56	1.87
16	002727	一心堂	2,496,848.00	1.86
17	002588	史丹利	2,409,772.00	1.80
18	688279	峰昭科技	2,399,032.51	1.79
19	603611	诺力股份	2,326,292.00	1.74
20	002483	润邦股份	2,322,852.00	1.73

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	688416	恒烁股份	3,766,768.25	2.81
2	600886	国投电力	2,858,590.74	2.13
3	600900	长江电力	2,838,836.00	2.12
4	600025	华能水电	2,825,138.38	2.11
5	002396	星网锐捷	2,627,954.61	1.96
6	301215	中汽股份	2,619,253.72	1.95
7	601988	中国银行	2,546,309.93	1.90
8	688409	富创精密	2,517,093.28	1.88
9	601939	建设银行	2,513,637.26	1.88
10	601398	工商银行	2,423,785.06	1.81
11	601096	宏盛华源	2,421,604.51	1.81
12	601126	四方股份	2,420,474.91	1.81
13	600236	桂冠电力	2,394,587.74	1.79
14	301051	信濠光电	2,373,149.76	1.77
15	002761	浙江建投	2,318,406.68	1.73
16	601288	农业银行	2,304,488.82	1.72
17	688519	南亚新材	2,278,718.66	1.70
18	000650	仁和药业	2,210,155.11	1.65
19	003043	华亚智能	2,189,849.73	1.63
20	688299	长阳科技	2,174,672.35	1.62

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	613,938,229.41
卖出股票收入（成交）总额	644,261,243.77

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约定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	50,744.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	365,604.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	416,348.22
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
诺德量化核心 A	3,805	12,980.11	-	-	49,389,329.14	100.00
诺德量化核心 C	1,973	11,160.29	47,622.23	0.22	21,971,633.61	99.78
合计	5,778	12,358.70	47,622.23	0.07	71,360,962.75	99.93

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	90.52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺德量化核心 A	55,335.46	0.11
	诺德量化核心 C	62,413.91	0.28
	合计	117,749.37	0.16

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	诺德量化核心 A	0~10
	诺德量化核心 C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本 开放式基金	诺德量化核心 A	0
	诺德量化核心 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德量化核心 A	诺德量化核心 C
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日) 基金份额总额	27,717,696.01	402,671,516.85
本报告期期初基金 份额总额	62,831,593.47	29,152,214.05
本报告期基金总申 购份额	11,293,555.81	11,570,474.97
减：本报告期基金 总赎回份额	24,735,820.14	18,703,433.18
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	49,389,329.14	22,019,255.84

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额；总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人未有受到监管部门调查或处罚的情形。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	1	271,546,277.64	21.58	118,367.15	21.58	-
天风证券	1	251,693,265.40	20.01	109,711.70	20.01	-
中国国际金融股份有限公司	2	188,521,262.79	14.99	82,179.90	14.99	-
太平洋证券	1	172,156,345.82	13.68	75,046.49	13.69	-
国联民生证券	2	124,690,994.45	9.91	54,352.39	9.91	-
甬兴证券	1	93,446,804.56	7.43	40,733.49	7.43	-
国泰海通证券	2	91,557,601.83	7.28	39,910.07	7.28	-
银河证券	2	56,479,374.26	4.49	24,618.63	4.49	-
广发证券	1	7,944,878.41	0.63	3,463.70	0.63	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

华鑫证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 5 日
2	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
3	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
4	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
5	诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
6	诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
7	诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年 2 月）	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
8	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
9	诺德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
10	诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
11	诺德基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛投资管理有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 8 日
12	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
13	诺德量化核心灵活配置混合型证券	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日

	投资基金 2026 年第 1 季度报告		
--	---------------------	--	--

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德量化核心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、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

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

诺德基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日