诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:诺德基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
送出日期:2019年3月27日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3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。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺德量化蓝筹	
基金主代码	005682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月29日	
基金管理人	诺德基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,083,107.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺德量化蓝筹A	诺德量化蓝筹C
下属分级基金的交易代码:	005682	005683
报告期末下属分级基金的份额总额	5,523.39份	1,077,584.44份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型,合理配置资产权重,精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求实现基金资产的长期,稳定增值。
投资策略	本基金将运用长期资产配置(SAA)和短期资产配置(TAA)相结合的方法,根据市场环境的变化,合理确定基金在股票、债券及货币市场上具等各类资产类别上的投资比例;在长期资产配置保持稳定增值的前提下,积极进行短期资产风云配置,构建在承受适当风险的前提下可获取较高收益的资产组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗丽娟	郑杰
	联系电话	021-68985058	0755-26951111
	电子邮箱	lijuan.luo@nuodefund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0009	95565
传真		021-68985121	0755-82960794

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年12月29日(基金合同生效日)-2017年12月31日		2016年	
	诺德量化蓝筹A	诺德量化蓝筹C	诺德量化蓝筹A	诺德量化蓝筹C	诺德量化蓝筹A	诺德量化蓝筹C
本期已实现收益	3,101.24	82,687.38	3,126.36	55,635.75	-	-
本期利润	2,258.04	-25,537.82	3,126.36	55,635.75	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0083	-0.0005	0.0003	0.0003	-	-
本期基金份额净值增长率	-17.68%	-17.86%	0.03%	0.03%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.2178	-0.2196	0.0003	0.0003	-	-
期末基金资产净值	4,548.23	885,296.74	10,757,815.00	195,121,238.24	-	-
期末基金份额净值	0.8234	0.8216	1.0003	1.0003	-	-

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

4、本基金合同生效日为2017年12月29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

诺德量化蓝筹A

阶段	份额净值增长率①①	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	-14.09%	0.94%	-6.54%	0.98%	-7.55%	-0.04%
过去六个月	-16.07%	0.90%	-7.08%	0.95%	-8.99%	0.00%
过去一年	-17.68%	0.66%	-12.92%	0.80%	-4.76%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-17.66%	0.66%	-12.78%	0.80%	-4.91%	-0.14%

诺德量化蓝筹C

阶段	份额净值增长率①①	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	-14.01%	0.94%	-6.54%	0.98%	-7.47%	-0.04%
过去六个月	-16.00%	0.89%	-7.08%	0.94%	-8.92%	-0.01%
过去一年	-17.86%	0.66%	-12.92%	0.80%	-4.94%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-17.84%	0.66%	-12.75%	0.80%	-5.09%	-0.14%

注:业绩比较基准为沪深300指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*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

注:本基金的合同于 2017 年 12 月 29 日生效,图示时间段为 2017 年 12 月 29 日至2018 年 12月 31日基金净值增长率与业绩基准收益率比较。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2017年12月29日,自基金合同生效以来未发生利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88号文批准设立。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理(北京)有限公司,注册地为上海,注册资本为1亿元人民币。截至本报告期末,公司管理了十八只开放式基金:诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选30混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证300指数分级证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金以及诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾文奎	本基金基金经理以及诺德新享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、诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理	2017年12月29日	-	6	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,担任长期股权投资(FOF)管理部高级研究员,FOF管理部投资经理等职务,具有基金从业资格。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为保证各类托投资资金的安全,保证本公司各项资产管理业务的正常运行,维护投资者的合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定,基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》,确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合,严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,其规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体的控制措施包括:

一、实施信息隔离制度:公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;

二、公平分享研究分析报告:所有研究报告均在公司内网平台上发布,但是禁止在其他公开渠道发布,各组合经理同步获取研究分析报告资料;

三、严格控制同日反向交易:原则上禁止不同投资组合之间的同日反向交易,确实由于投资组合的投资决策或流动性等需要而发生的同日反向交易,相关投资组合经理应向投资决策委员会提供决策依据并留存记录备案;

四、公平执行交易指令:(1)交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时,除需经过公平性审核的例外指令外,必须开启系统的公平交易开关;(2)不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易,对于需要分配交易量的交易,应当填写《公平交易审批表》,按比例分配的原则实施分配,保证不同投资组合获得公平的交易机会;(3)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易,应当实施公平性审核,填写《公平交易审批表》,报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

五、实施事前审核和事后稽核:公司风险管理部门根据市场公认的第三方信息对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行事前审查,对公平交易的不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行事中监控,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行事后分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。本公司在2018年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经T检验分析和贡献率分析,本投资组合与其他投资组合日内、3日内、5日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况,也未发现其他存在利益输送的情况。

4.3.3 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,本基金与其它组合之间未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易,也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年,国内宏观经济仍然处于平稳增长、结构转型升级的过程中。就股票二级市场而言,受中美贸易摩擦和市场对未来经济预期波动的影响,2018年股票市场出现了震荡下跌,整年上证综指跌幅24.59%,上证50跌幅19.83%,沪深300指数下跌25.31%,中证500指数下跌33.32%,中小板指数下跌37.75%,创业板指数下跌28.65%,市场呈现普遍下跌态势。

2018年建仓期结束之后,本基金仓位维持在50%以上,通过量化模型选择蓝筹股票,同时结合行业配置策略,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,本基金主要采用量化技术手段,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2018年12月31日,诺德量化蓝筹A类份额净值为0.8234元,累计净值为0.8234元。本报告期份额净值增长率为-17.68%,同期业绩比较基准增长率为-12.92%。诺德量化蓝筹C类份额净值为0.8216元,累计净值为0.8216元。本报告期份额净值增长率为-17.86%,同期业绩比较基准增长率为-12.92%。

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结构转型升级的大背景中,十二月中下旬中央经济工作会议召开,市场受政策面因素的影响,存在着结构性机会,我们认为政策的延续性值得关注,同时我们会认真挖掘其中机会。国际层面上来说,欧美经济复苏,美联储缩表态势之前明显,目前有所软化,全球金融层面也存在一定变数,我们认为随着贸易摩擦相关信息逐步尘埃落定,不确定的因素会归为确定,市场低迷情况下,很多的不确定因素都会解读为严重利空,而当不确定性塌缩之后,市场情绪会有较大幅度的好转。

本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度,以低估值蓝筹配置为主,适当关注业绩逐步体现的成长公司,主要通过数量化模型,合理配置资产权重,精选个股,在充分控制投资风险的前提下,力求实现基金资产的长期、稳定增值。

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;

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

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性,以及负责具体信息披露工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内,本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元、基金份额持有人数量不满两百人的情形,本基金管理人以及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21269号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金全体基金份额持有人;
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(以下简称"诺德量化蓝筹混合基金")的财务报表,包括2018年12月31日和2017年12月31日的资产负债表,2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了诺德量化蓝筹混合基金2018年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获得的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于诺德量化蓝筹混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	诺德量化蓝筹混合基金的基金管理人诺德基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及会计的基础在财务编制财务报表,使其不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估诺德量化蓝筹混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算诺德量化蓝筹混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督诺德量化蓝筹混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响基于财务报表做出经济决策的合理性,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性作出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对诺德量化蓝筹混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息,然而,未来的事项或情况可能导致诺德量化蓝筹混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮 | 郁晓燕
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2019年3月22日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		761,827.41	205,844,979.56
结算备付金		57.45	-
存出保证金		5,907.81	-
交易性金融资产		483,250.40	-
其中:股票投资		483,250.40	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		166.23	45,285.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,251,209.30	205,890,265.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		17.11	-
应付管理人报酬		625.33	9,024.93
应付托管费		78.16	1,128.12
应付销售服务费		77.75	1,069.17
应付交易费用		565.94	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		360,000.04	-
负债合计		361,364.33	11,222.22
所有者权益:			
实收基金		1,083,107.83	205,820,281.13
未分配利润		-193,262.86	58,762.11
所有者权益合计		889,844.97	205,879,043.24
负债和所有者权益总计		1,251,209.30	205,890,265.46

注:

1. 报告截止日2018年12月31日,基金份额总额为1,083,107.83份,其中A类基金份额总额5,523.39份,基金份额净值0.8234元;C类基金份额总额1,077,584.44份,基金份额净值0.8216元。报告截止日2017年12月31日,基金份额总额为205,820,281.13份,其中A类基金份额总额10,754,678.64份,基金份额净值1.0003元;C类基金份额总额195,065,602.49份,基金份额净值1.0003元。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31止期间。

7.2 利润表

会计主体:诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入		881,539.00	69,984.33
1.利息收入		1,314,487.62	12,350.70
其中:存款利息收入		161,851.45	12,350.70
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		1,152,636.17	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-402,315.56	-
其中:股票投资收益		-456,877.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		54,561.46	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-109,068.40	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		78,435.34	57,633.63
减:二、费用		904,838.78	11,222.22
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	416,180.22	9,024.93
2.托管费	7.4.8.2.2	52,022.59	1,128.12
3.销售服务费	7.4.8.2.3	51,605.94	1,069.17
4.交易费用		24,610.03	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用		360,400.00	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-23,279.78	58,762.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-23,279.78	58,762.11

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	205,820,281.13	58,762.11	205,879,043.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,279.78	-23,279.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净赎回以"-"号填列)	-204,737,173.30	-228,745.19	-204,965,918.49
其中:1.基金申购款	2,387,992.39	-171,244.49	2,416,747.90
2.基金赎回款	-207,325,165.69	-57,500.70	-207,382,666.39
五、期末所有者权益(基金净值)	1,083,107.83	-193,262.86	889,844.97

项目	上年度可比期间 2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	205,820,281.13	-	205,820,281.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,762.11	58,762.11
三、期末所有者权益(基金净值)	205,820,281.13	58,762.11	205,879,043.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德量化蓝筹增强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]1409号《关于准予诺德量化蓝筹增强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《诺德量化蓝筹增强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205,779,736.73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1104号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,820,281.13份基金份额,其中认购资金利息折合40,544.40份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,投资者可自行选择基金份额类别进行认购/申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化蓝筹增强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、证券公司短期公司债、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、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50%-95%,权证投资占基金资产净值的0%-3%,每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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%+中证综合债券指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于2019年3月22日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年12月31日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年12月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的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。

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。

7.4.4.5 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