

诺德天禧基金 2016 年第四季度报告

公告日期：2017-01-19

流水号：FB03201701180864

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

本报告期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

自基金合同生效以来基金累计份额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

其他指标

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

公平交易专项说明

公平交易专项说明

公平交易制度和控制方法

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金投资策略和运作分析

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

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
申明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
其他资产构成
报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
开放式基金份额变动
基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

诺德天禧

场内简称

-

基金主代码

003101

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2016-08-15

报告期末基金份额总额

497,835,784.07

投资目标

本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系，形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期，并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析，综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素，主动构建和调整投资组合，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资收益的目的。

业绩比较基准

中证综合债券指数收益率

风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的风险较低的品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

基金管理人

诺德基金管理有限公司

基金托管人

中国民生银行股份有限公司

基金保证人

-

主要财务指标

单位：人民币元

项目

2016-10-01 至 2016-12-31(元)

本期已实现收益

1,807,319.71

本期利润

-11,045,827.29

加权平均基金份额本期利润

-0.0279

期末基金资产净值

489,973,068.36

期末基金份额净值

0.9842

注：注：1.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。

2.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。

基金净值表现

本报告期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

净值增长率①

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

-1.92%

0.13%

-1.41%

0.12%

-0.51%

0.01%

自基金合同生效以来基金累计份额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：注：本基金的合同于 2016 年 8 月 15 日生效，图示时间段为 2016 年 8 月 15 日-2016 年 12 月 31 日。本基金成立未满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，截止 2016 年 12 月 31 日，本基金建仓期尚未结束。

其他指标

单位：元

序号

其他指标

报告期（2016-10-01 至 2016-12-31）

序号

其他指标

报告期（2016-12-31）

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

赵滔滔

本基金基金经理、诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理、诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）基金经理和诺德货币市场基金基金经理

2016-08-15

-

9

上海财经大学金融学硕士。2006 年 11 月至 2008 年 10 月，任职于平安资产管理有限责任公司。2008 年 10 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任债券交易员，固定收益研究员等职务。现任公司固定收益部总监，具有基金从业资格。

朱红

本基金基金经理以及诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理

2016-11-16

-

8

大连理工大学工商管理硕士。2007年8月至2009年10月在新华基金管理有限公司投资管理部担任投资总监助理、基金经理助理。2009年11月加入诺德至今，先后担任投资研究部高级研究员、基金经理助理职务。现任投资研究部投资副总监，具有基金从业资格。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为0.984元，累计净值为0.984元。本报告期份额净值增长率为-1.92%，同期业绩比较基准增长率为-1.41%。

报告期内基金投资策略和运作分析

2016年第四季度债券市场大幅下跌。受央行公开市场锁短放长操作以及商业银行MPA考核影响，债券市场资金面骤紧，以同业存款、同业存单为代表的银行负债端成本大幅上升，从而导致债券市场收益率快速上行，流动性缺失。直至年底大行在央行指导下重新向市场投放资金，债券市场收益率上行的势头才被遏制。

本季度本基金仍处于建仓期。主要的操作是分批次买入了资质较好的中票、企业债等品种，组合仓位上升较快。同时，以长久期利率债为工具进行了低仓位的波段操作。报告期内本基金跑输业绩比较基准主要是因为债券组合仓位较高、久期较长。

2017 年供给侧改革深化、宏观经济运行指标的变化、以及央行的稳健中性货币政策，都将是影响债券市场的重要因素。经历了 2016 年年末的债券收益率快速上行之后，短期内收益率曲线正在得到修复。对于中长期收益率的走势，则需要密切关注宏观经济指标，做出谨慎判断。

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

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

12,365,308.20

2.52

其中：股票

12,365,308.20

2.52

2

固定收益投资

403,619,352.40

82.29

其中：债券

403,619,352.40

82.29

资产支持证券

-

-

3

贵金属投资

-

-

4

金融衍生品投资

-

-

5

买入返售金融资产

60,000,315.00

12.23

其中：买断式回购的买入返售金融资产

-

-

6

银行存款和结算备付金合计

7,506,202.07

1.53

7

其他资产

7,005,092.22

1.43

8

合计

490,496,269.89

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号

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

-

-

C

制造业

8,013,580.20

1.64

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

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

862,920.00

0.18

J

金融业

-

-

K

房地产业

-

-

L

租赁和商务服务业

3,488,808.00

0.71

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

12,365,308.20

2.52

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：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

000920

南方汇通

435,060

6,295,318.20

1.28

2

300269

联建光电

150,900

3,488,808.00

0.71

3

002007

华兰生物

47,000

1,680,250.00

0.34

4

300339

润和软件

28,200

862,920.00

0.18

5

002294

信立泰

1,300

38,012.00

0.01

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

-

-

2

央行票据

-

-

3

金融债券

29,977,000.00

6.12

其中：政策性金融债

29,977,000.00

6.12

4

企业债券

176,343,352.40

35.99

5

企业短期融资券

59,664,000.00

12.18

6

中期票据
137,635,000.00
28.09

7

可转债（可交换债）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

403,619,352.40

82.38

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
金额单位：元

序号

债券代码

债券名称

数量（张）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

1680032

16 闽中名城债

200,000

20,096,000.00

4.10

2

1680444

16 徐州高新债

210,000

19,996,200.00

4.08

3

160211

16 国开 11

200,000

19,966,000.00

4.07

4

101662034

16 甬保投 MTN001

200,000

19,924,000.00

4.07

5

011698945

16 陕煤化 SCP012

200,000

19,896,000.00

4.06

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

金额单位：元

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金未投资贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
代码
名称
持仓量（买卖）
合约市值(元)
公允价值变动(元)
风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)

-
国债期货投资本期收益（元）

-
国债期货投资本期公允价值变动(元)

-
本基金未投资国债期货。
本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
单位：元
序号
证券代码
证券名称
数量（份）
公允价值（元）
占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明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。

其他资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

9,122.21

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

6,982,679.60

5

应收申购款

13,290.41

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

7,005,092.22

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号

债券代码

债券名称

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

200,226,513.54

报告期期间基金总申购份额

298,045,827.93

报告期期间总赎回份额

436,557.40

报告期期间基金拆分变动份额

-

报告期期末基金份额总额

497,835,784.07

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

基金管理人运用自有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目

份额总额(份)

报告期期初管理人持有的本基金份额

-

报告期期间买入申购总份额

-

报告期期间卖出赎回总份额

-

报告期期末管理人持有的本基金份额

-

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-

基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

-

注：本报告期内，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

- 2、《诺德天禧债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德天禧债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德天禧债券型证券投资基金本季度报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

存放地点

基金管理人和或基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：

<http://www.nuodefund.com>。

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，或发电子邮件，E-mailservice@nuodefund.com。