

诺德安盈纯债债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 1 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	诺德安盈
场内简称	-
基金主代码	008937
交易代码	008937
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,464,693,846.53 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，构建投资组合的久期水平、期限结构和类属配置，并根据市场变化及时进行调整，力求获取长期稳健的投资收益。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年4月1日—2022年6月30日）
1. 本期已实现收益	11,611,306.09
2. 本期利润	16,387,043.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0112
4. 期末基金资产净值	1,509,327,447.88
5. 期末基金份额净值	1.0305

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。

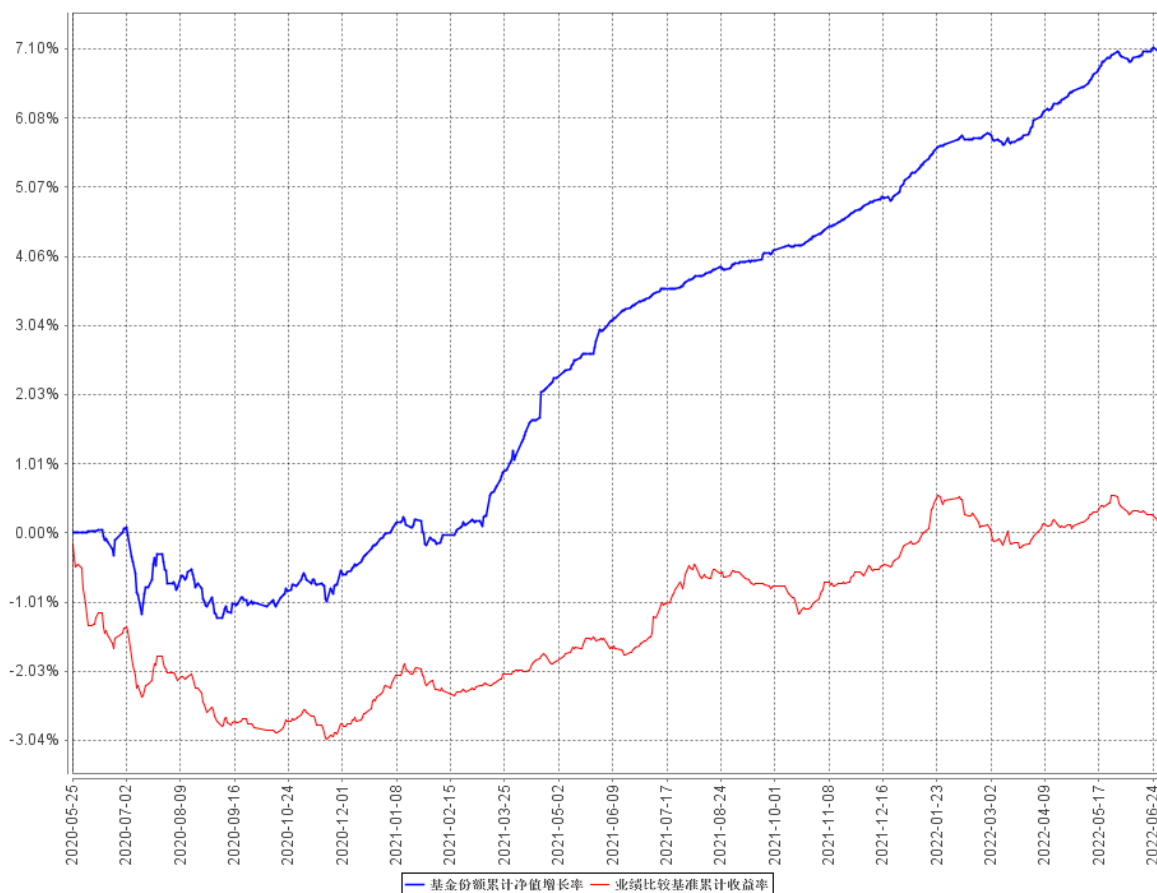
3.2 基金净值表现

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	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	1.10%	0.02%	0.29%	0.04%	0.81%	-0.02%
过去六个月	1.84%	0.03%	0.38%	0.05%	1.46%	-0.02%
过去一年	3.58%	0.02%	1.83%	0.05%	1.75%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	7.12%	0.06%	0.20%	0.06%	6.92%	0.00%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2020 年 5 月 25 日，图示时间段为 2020 年 5 月 25 日至 2022 年 6 月 30 日。

本基金建仓期间自 2020 年 5 月 25 日至 2020 年 11 月 24 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		
景辉	本基金基金经理、	2020 年 5 月 25 日	-	9	上海财经大学金融学硕士。2005 年 2 月至

	诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理、诺德短债债券型证券投资基金基金经理、诺德安瑞39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金基金经理、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金基金经理				2017年4月期间，先后任职于金川集团、浙江银监局、杭州银行股份有限公司。2017年5月加入诺德基金管理有限公司，从事投资研究工作，具有基金从业资格。
--	---	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年二季度，国内疫情逐步得到有效控制，复工复产成为主基调，国内经济修复态势良好，而全球通胀形势比较严峻。本产品在二季度仍以杠杆套息策略为主。

二季度疫情逐步受控，中国经济复苏态势渐渐明朗化。6 月制造业 PMI 为 50.2，6 月非制造业 PMI 为 54.7，双双跃升至扩张区间。表明随着国内疫情得到有效控制，供应链在逐步恢复，经济动能也开始向上修复。

细观国内经济，隐忧仍存。一是疫情仍有反复。从全国疫情跟踪态势看，各地散点式爆发始终不绝，导致地区之间无论人口流动、还是物流等仍存在较多的不确定性，就业、收入显著承压，是内需不振的主因之一。二是房地产市场深度收缩态势仍未改变，全国百强房企销售金额及销售面积仍处于深度负值区间，各地土地出让金收入急剧收缩，土地市场降温明显。三是以石油为代表的大宗商品价格持续上升，猪肉价格也走出底部，通胀压力已不容忽视。

虽然国内经济仍然承压，但以上海为代表的多数前期受影响地区经济活动已经逐步趋于正常化，随着后续经济支持政策的陆续出台，国内经济有望明显提振。经济缓步修复、通胀上扬、全球央行货币政策逐步回归常态化，一系列因素对当前债市均不友好，因此我们认为中短期看，债券尤其是利率债的风险是在提升的，组合投资仍需谨慎。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0305 元，累计净值为 1.0705 元。本报告期份额净值增长率为 1.10%，同期业绩比较基准增长率为 0.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,824,670,552.64	99.36
	其中：债券	1,803,026,772.08	98.18
	资产支持证券	21,643,780.56	1.18
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	11,795,069.79	0.64
8	其他资产	-	-
9	合计	1,836,465,622.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	987,983,454.27	65.46
	其中：政策性金融债	391,465,835.62	25.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,660,427.40	6.01
6	中期票据	724,382,890.41	47.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,803,026,772.08	119.46

5.5 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债券投资明细

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	092118003	21 农发清发 03	2,400,000	246,943,890.41	16.36
2	1920074	19 东莞银行二级	1,300,000	137,826,712.33	9.13
3	102280541	22 远东租赁 MTN001	1,000,000	101,800,323.29	6.74

4	210312	21 进出 12	900,000	91,501,027.40	6.06
5	012280817	22 广东农垦 SCP001(乡村振兴)	900,000	90,660,427.40	6.01

5.6 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资产支持证券投资明细

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（%）
1	193718	21 欧拉 3A	400,000	21,643,780.56	1.43

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，17 民生银行二级 01 的发行主体中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）、18 中国银行二级 02 的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）、19 农业银行二级 02 的发行主体中

国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）存在被监管公开处罚的情形。

1、17 民生银行二级 01

根据 2022 年 3 月 21 日的行政处罚决定，民生银行因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送贸易融资业务 EAST 数据；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；七、未报送其他担保类业务 EAST 数据；八、未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 EAST 数据；九、漏报委托贷款业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、报送不实数据；十六、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产，被中国银行保险监督管理委员会罚款 490 万元。

根据 2021 年 7 月 13 日的行政处罚决定，民生银行因一、监管发现问题屡查屡犯；二、检查发现问题整改不到位；三、对责任人员的责任认定和问责不到位；四、内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突；五、配合现场检查不力；六、信息系统管控有效性不足；七、未向监管部门真实反映业务数据；八、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；九、理财业务整改转型不符合监管要求；十、违规调整理财产品收益；十一、理财产品收益兑付不合规；十二、违规调节理财业务利润；十三、使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产；十四、理财产品间相互交易资产调节收益；十五、理财产品未实现账实相符、单独托管；十六、理财产品投资清单未反映真实情况，合格投资者认定不审慎；十七、开放式公募理财产品投资杠杆水平超标；十八、公募理财产品持有单只证券市值比例超标；十九、开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标；二十、理财产品信息登记不规范；二十一、理财产品信息披露不规范；二十二、理财产品托管不尽职；二十三、违规开展委托资产管理业务；二十四、同业业务未实行专营部门制；二十五、同业业务交易对手管理不健全；二十六、同业业务统一授信管理不到位；二十七、违规将转贴现票据转为投资资产，未真实反映票据规模；二十八、会计核算不规范；二十九、发行虚假结构性存款产品；三十、未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本；三十一、委托贷款委托人资质审查不审慎，被中国银行保险监督管理委员会罚款 11450 万元。

2、18 中国银行二级 02

根据 2022 年 5 月 26 日的行政处罚决定，中国银行因理财业务存在以下违法违规行为：老产品规模在部分时点出现反弹，被中国银行保险监督管理委员会罚款 200 万元。

根据 2022 年 3 月 21 日的行政处罚决定，中国银行因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、漏报债券投资业务 EAST 数据；六、未报送权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报公募基金投资业务 EAST 数据；八、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；九、漏报其他担保类业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报，被中国银行保险监督管理委员会罚款 480 万元。

3、19 农业银行二级 02

根据 2022 年 3 月 21 日的行政处罚决定，农业银行因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报贷款核销业务 EAST 数据；二、未报送权益类投资业务 EAST 数据；三、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；四、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；五、其他担保类业务 EAST 数据存在偏差；六、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；七、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、漏报分户账 EAST 数据；十、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十一、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、理财产品登记不规范；十七、2018 年行政处罚问题依然存在，被中国银行保险监督管理委员会罚款 480 万元。

根据 2021 年 12 月 8 日的行政处罚决定，农业银行因一、制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；二、农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重，被中国银行保险监督管理委员会罚款 150 万元。

对 17 民生银行二级 01、18 中国银行二级 02、19 农业银行二级 02 的投资决策程序的说明：

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

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

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

5.10.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,464,492,251.61
报告期期间基金总申购份额	360,753.42
减：报告期期间基金总赎回份额	159,158.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,464,693,846.53

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	198,056.20
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	198,056.20
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.01

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220401-20220630	1,463,781,342.15	-	-	1,463,781,342.15	99.94%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、《诺德安盈纯债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德安盈纯债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、诺德安盈纯债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。

9.2 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>。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

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

诺德基金管理有限公司

2022 年 7 月 21 日