

诺德新生活混合型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 04 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|---------|
| 基金简称 | 诺德新生活 | |
| 基金主代码 | 006887 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 3 月 28 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 44,514,245.17 份 | |
| 投资目标 | 本基金通过重点投资与新生活主题相关的优质企业，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 | 本基金采取相对稳健的资产配置策略。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，同时结合不同行业的基本面情况、市场预期变化情况及估值水平，确定合适的资产和行业配置比例，动态优化投资组合。 | |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率 | |
| 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。 | |
| 基金管理人 | 诺德基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 诺德新生活 A | 诺德新生活 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006887 | 006888 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 44,514,245.17 份 | -份 |

§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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------|
| | 诺德新生活 A 类 | 诺德新生活 C 类 |
| 1. 本期已实现收益 | 4,671,883.96 | - |
| 2. 本期利润 | 10,839,568.70 | - |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3112 | - |
| 4. 期末基金资产净值 | 53,482,844.88 | 0.00 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2015 | 1.2015 |

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。

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

诺德新生活 A 类

| 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 | 33.19% | 2.57% | 2.74% | 0.51% | 30.45% | 2.06% |
| 过去六个月 | 19.10% | 2.42% | 3.80% | 0.65% | 15.30% | 1.77% |
| 过去一年 | 20.41% | 2.18% | -1.95% | 0.68% | 22.36% | 1.50% |
| 过去三年 | 21.25% | 2.15% | 7.03% | 0.72% | 14.22% | 1.43% |
| 自基金合同 生效起至今 | 20.15% | 1.98% | 8.24% | 0.74% | 11.91% | 1.24% |

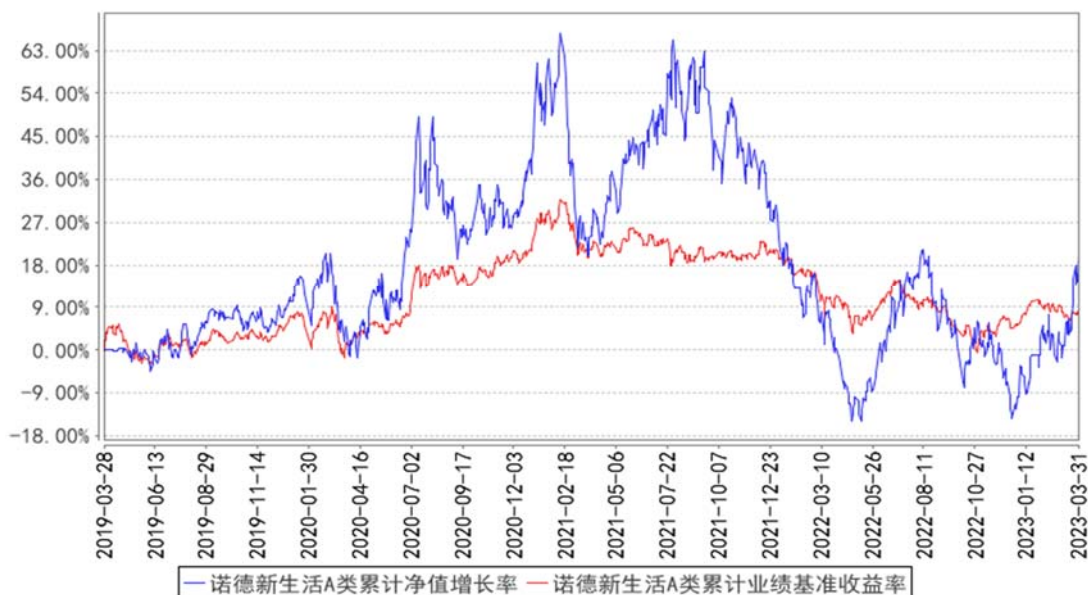
诺德新生活 C 类

| 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 |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

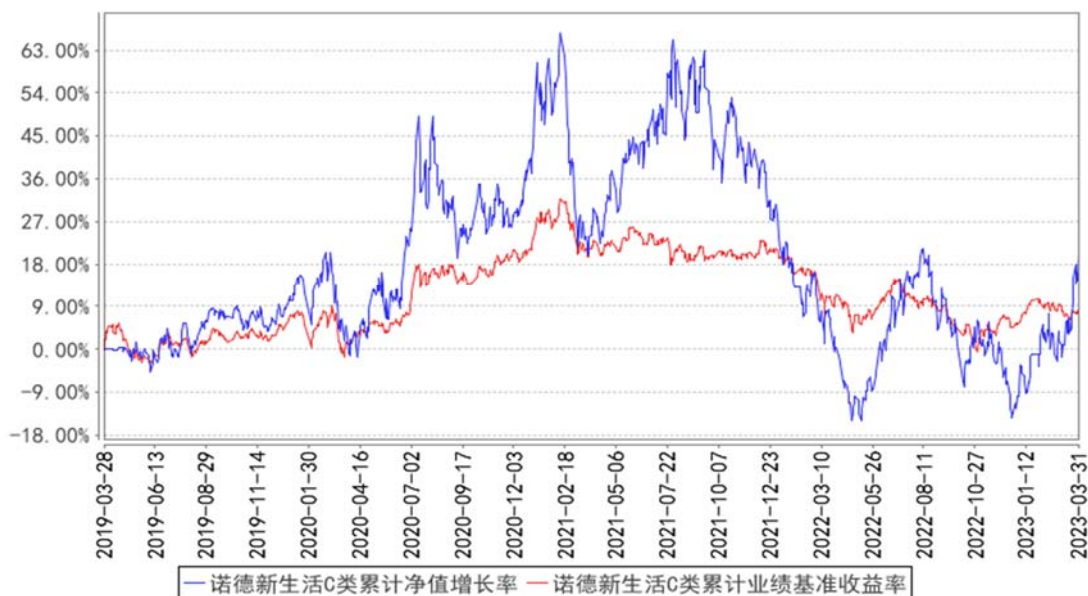
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 33.19% | 2.57% | 2.74% | 0.51% | 30.45% | 2.06% |
| 过去六个月 | 19.10% | 2.42% | 3.80% | 0.65% | 15.30% | 1.77% |
| 过去一年 | 20.41% | 2.18% | -1.95% | 0.68% | 22.36% | 1.50% |
| 过去三年 | 21.25% | 2.15% | 7.03% | 0.72% | 14.22% | 1.43% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.15% | 1.98% | 8.24% | 0.74% | 11.91% | 1.24% |

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

诺德新生活A类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



诺德新生活C类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 2019 年 3 月 28 日，图示时间段为 2019 年 3 月 28 日至 2023 年 3 月 31 日。

本基金建仓期间自 2019 年 3 月 28 日至 2019 年 9 月 27 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 | | |
| 周建胜 | 本基金基金经理 | 2022 年 7 月 14 日 | - | 8 年 | 上海交通大学微电子学与固体电子学硕士。历任希姆通信息技术（上海）有限公司软件工程师、华为技术有限公司软件工程师、上海玖石股权投资管理有限公司研究员、上海陆宝投资管理有限公司研究员。2019 年 7 月加入诺德基金管理有限公司,担任 TMT 行业高级研究员,具有基金从业资格。 |
| 潘永昌 | 本基金基金经理以及诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金的基金经理 | 2020 年 3 月 3 日 | - | 7 年 | 上海对外经贸大学金融学硕士。2011 年 9 月至 2013 年 8 月任职于上海汇麟投资有限公司,担任投资研究部数量研究员职务。2016 年 4 月加入诺德基金管理有限公司,先后担任投资研究部宏观策略研究员、量化投资部量化研究员职务。潘永昌先生具有基金从业资格。 |

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年第一季度，申万一级行业中，计算机涨幅 36.79%，传媒涨幅 34.24%，电子涨幅 15.5%，通信涨幅 29.51%，均跑赢了沪深 300 的 4.63% 涨幅。回溯 2023 年第一季度，TMT 行情非常火爆，坐拥数字经济政策支持与 AI 产业创新两大驱动力。在数字经济政策方面，中共中央国务院印发《数字中国建设整体布局规划》（以下简称《规划》），《规划》明确，数字中国建设按照“2522”的整体框架进行布局，即夯实数字基础设施和数据资源体系“两大基础”，推进数字技术与经济、政治、文化、社会、生态文明建设“五位一体”深度融合，强化数字技术创新体系和数字安全屏障“两大能力”，优化数字化发展国内国际“两个环境”，我们认为这份文件指明了未来中国数字化的大方向。在 AI 产业创新方面，相关产业巨头的动作刺激了 A 股行情的展开。

报告期内，本基金抓住了数字经济政策红利和 AI 产业创新机会，积极对组合进行了优化，从而取得了比较好的投资回报。

展望 2023 年第二季度，我们预期更多的数字经济政策细则将进入落地阶段——密切关注国

家数据局的动向，信创相关的订单预期开始释放出来，数字经济板块预期还会有比较好的投资机会。随着 GPT-4 的推出，我们预期 AI 大模型军备竞赛将会加剧，我们将继续看好 GPT 相关的投资机会。近期 TMT 板块占全市场的成交比例比较高，市场上有担心交易拥挤的担忧，我们对此做了自己的分析：当机构对 TMT 持仓在历史高位时，那可能意味着风险的概率更大；反之当机构持仓处于历史较低位置，而 TMT 产业又出现令人惊喜的创新突破的时候，所谓的“交易拥挤”可能是资金抢门票的行为。对比历史数据，我们认为当下市场阶段性震荡或不可避免，但整体依然是理性的。

新生活定位于 TMT 主题基金，我们认为 2023 年 TMT 板块的投资主线已经逐渐浮现出来。

2023 年我们将继续围绕政策鼓励和产业创新两大方向来布局，主要思路如下：

1) ChatGPT 产业链机会：我们将继续在数据、算法、算力、应用等环节来挖掘机会，根据市场表现，在各大细分领域之间优化配置。在产业热点持续不断的背景下，我们将采取积极有为的态度，力争在 ChatGPT 产业链继续为大家挖掘更多机会。

2) 信创产业链机会：我们认为信创产业正进入加速推进阶段，我们将继续关注操作系统、数据库、中间件、应用软件、信息安全、基础硬件等细分领域的投资机会。

3) 数据要素机会：随着土地、人口等传统要素红利的衰退，我们认为数据要素产业有望迎来加速发展，而 ChatGPT 们的崛起则更是有望进一步加速数据价值的释放，我们认为这是继信创、ChatGPT 之后下一个投资蓝海市场。

4) 芯片的拐点机会：中国要提高重点产业链自主可控能力，为了突破关键核心技术和零部件薄弱环节，新型举国体制的有效落地可以期待；随着半导体产业周期探底，我们可能正非常接近半导体周期拐点，我们将继续密切关注潜在的拐点机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，诺德新生活 A 类份额净值为 1.2015 元，累计净值为 1.2015 元。本报告期基金份额净值增长率为 33.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.74%。诺德新生活 C 类份额净值为 1.2015 元，累计净值为 1.2015 元。本报告期基金份额净值增长率为 33.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金曾存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 48,623,456.63 | 86.53 |
| | 其中：股票 | 48,623,456.63 | 86.53 |
| 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 | 4,876,575.78 | 8.68 |
| 8 | 其他资产 | 2,692,200.68 | 4.79 |
| 9 | 合计 | 56,192,233.09 | 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

| 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 | - | - |
| C | 制造业 | 12,804,715.26 | 23.94 |
| 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 | 31,947,455.57 | 59.73 |
| J | 金融业 | 2,722,501.80 | 5.09 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,148,784.00 | 2.15 |
| 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 | 48,623,456.63 | 90.91 |

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

| 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 | 688041 | 海光信息 | 46,460 | 3,585,318.20 | 6.70 |
| 2 | 688111 | 金山办公 | 7,052 | 3,335,596.00 | 6.24 |
| 3 | 300474 | 景嘉微 | 27,025 | 3,297,050.00 | 6.16 |
| 4 | 002230 | 科大讯飞 | 46,883 | 2,985,509.44 | 5.58 |
| 5 | 300229 | 拓尔思 | 88,019 | 2,785,801.35 | 5.21 |
| 6 | 600570 | 恒生电子 | 51,800 | 2,756,796.00 | 5.15 |
| 7 | 300033 | 同花顺 | 13,326 | 2,722,501.80 | 5.09 |
| 8 | 300634 | 彩讯股份 | 90,444 | 2,504,394.36 | 4.68 |
| 9 | 301236 | 软通动力 | 49,900 | 2,495,000.00 | 4.67 |
| 10 | 688256 | 寒武纪-U | 12,665 | 2,355,056.75 | 4.40 |

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 45,805.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,646,395.18 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,692,200.68 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 诺德新生活 A 类 | 诺德新生活 C 类 |
|---------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初基金份额总额 | 26,995,575.50 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 35,285,925.42 | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 17,767,255.75 | - |
| 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 | 44,514,245.17 | - |

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

本报告期内，本基金管理人未持有本基金份额。

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

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。

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、《诺德新生活混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德新生活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、诺德新生活混合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

2023 年 4 月 22 日