

# 诺德安盛纯债债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	诺德安盛
场内简称	-
基金主代码	011094
交易代码	011094
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 12 日
报告期末基金份额总额	3,497,289,702.47 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	交通银行股份有限公司

### § 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（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	25,440,574.94
2. 本期利润	25,992,395.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0074
4. 期末基金资产净值	3,539,371,296.14
5. 期末基金份额净值	1.0120

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。

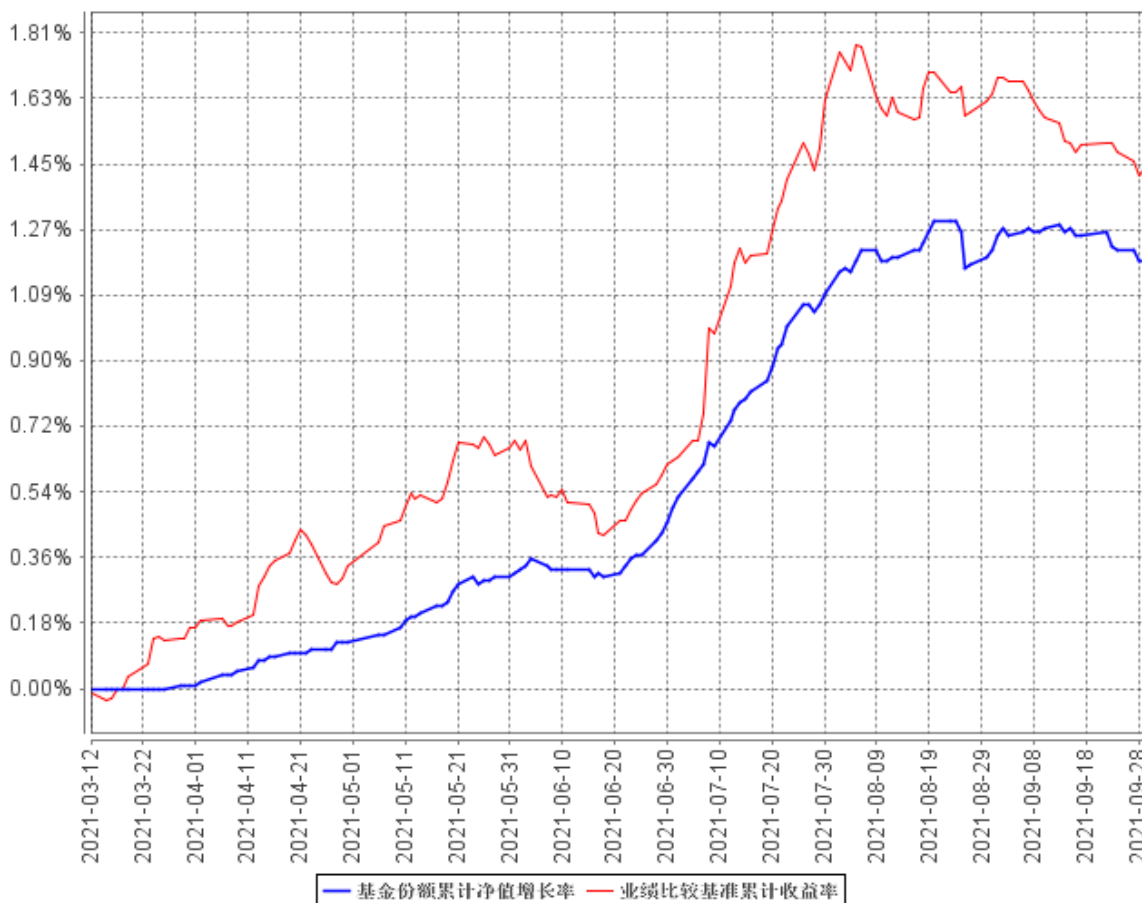
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.74%	0.03%	0.83%	0.06%	-0.09%	-0.03%
过去六个月	1.19%	0.02%	1.28%	0.05%	-0.09%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	1.20%	0.02%	1.46%	0.04%	-0.26%	-0.02%

### 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 2021 年 3 月 12 日，图示时间段为 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 9 月 30 日。

本基金成立未满 1 年。本基金建仓期间自 2021 年 3 月 12 日至 2021 年 9 月 11 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、	2021 年 3 月 12 日	-	8	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、诺德安盈纯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				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。
赵滔滔	本基金基金经理、诺德货币市场基金经理、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金的基金经理	2021年4月16日	-	14	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、固定收益部总监等职务，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**

第三季度国内经济增速放缓，稳增长压力加大。央行保持了稳健中性的货币政策，各项政策利率保持不变。另外，7 月上旬，央行时隔 1 年多来再次降准，债券市场资金充裕，资金面保持平稳。从债券市场表现上来看，降准引爆市场热情，7 月份债券收益率震荡下行，8、9 月份保持

窄幅震荡。

报告期内，本基金配置品种以中、高等级信用品种为主，同时久期控制在适中水平。目前组合仓位适中，未来将根据市场情况灵活调整投资策略，争取保持组合稳健运行。

展望 2021 年第四季度，经济稳增长压力增加，可以期待的更多是政策的变化。另外，通胀上行、债券供给量增加等因素也值得重点关注。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.0120 元，累计净值为 1.0120 元。本报告期份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准增长率为 0.83%。

#### 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	3,215,360,800.00	90.81
	其中：债券	3,092,284,000.00	87.33
	资产支持证券	123,076,800.00	3.48
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	266,940,560.35	7.54
8	其他资产	58,417,227.03	1.65
9	合计	3,540,718,587.38	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。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 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	2,230,840,000.00	63.03
	其中：政策性金融债	211,452,000.00	5.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	861,444,000.00	24.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,092,284,000.00	87.37

## 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	1828002	18 农业银行二级 01	3,300,000	337,788,000.00	9.54
2	1728021	17 工商银行二级 01	3,300,000	337,689,000.00	9.54
3	1728017	17 中国银行二级 01	3,300,000	334,752,000.00	9.46
4	2028044	20 广发银行二级 01	2,700,000	276,534,000.00	7.81
5	1920066	19 上海银行二级	2,500,000	256,350,000.00	7.24

## 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	136040	铁建 Y10A	700,000	70,126,000.00	1.98
2	189597	21 电建 3A	500,000	49,940,000.00	1.41
3	189549	G3 电建 3A	30,000	3,010,800.00	0.09

## 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，18 农业银行二级 01 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”）、17 工商银行二级 01 的发行主体中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）、17 中国银行二级 01 的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）、19 上海银行二级的发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）、21 建设银行小微债的发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）、12 中信银行 01 的发行主体中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）存在被监管公开处罚的情形。

#### 1、18 农业银行二级 01

根据 2021 年 1 月 19 日的行政处罚决定，因农业银行：（一）发生重要信息系统突发事件未报告；（二）制卡数据违规明文留存；（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（四）数据安全管理工作较粗放，存在数据泄露风险；（五）网络信息系统存在较多漏洞；（六）互联网门户网站泄露敏感信息，被中国银行保险监督管理委员会罚款 420 万元。

根据 2020 年 12 月 7 日的行政处罚决定，因农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费），被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

#### 2、17 工商银行二级 01

根据 2020 年 12 月 25 日的行政处罚决定，工商银行因：一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；二、关键岗位未进行实质性轮岗；三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；四、为同业投资业务提供隐性担保；五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；六、非标准化债权资产限额测算不准确；七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；九、为违规的政府购买服务项目提供融资；十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；十五、全权委托业务不规范；十六、用其他资金支付结构性存款收益；十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；十八、理财资金承接本行自营贷款；十九、封闭式理财产品相互交易调节收益；二十、滚动发行产品承接风险资产，且

按原价交易调节收益；二十一、高净值客户认定不审慎；二十二、理财产品信息披露不到位；二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记，被中国银行保险监督管理委员会罚款 5470 万元。

### 3、17 中国银行二级 01

根据 2021 年 5 月 17 日的行政处罚决定，因中国银行：一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；二、违规向关系人发放信用贷款；三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款；四、存款月末冲时点；五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票；六、贷款管理不严，信贷资金被挪用；七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户；八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足；九、超比例发放并购贷款；十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款；十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款；十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务；十三、与名单外交易对手开展同业业务；十四、违规为他行开立投融资性同业账户；十五、以同业返存方式不当吸收存款；十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离；十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票；十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况；十九、违规向四证不全房地产项目提供融资；二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款；二十一、理财资金违规用于土地储备项目；二十二、理财非标融资入股商业银行；二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资；二十四、超授信额度提供理财非标融资；二十五、买入返售业务标的资产不合规；二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品；二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品；二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置；二十九、通过平移贷款延缓风险暴露；三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备；三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产；三十二、迟报案件信息；三十三、案件问责不到位；三十四、提供质价不符的服务；三十五、违规收取福费廷风险承担费；三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费，被中国银行保险监督管理委员会罚没 8761.355 万元。

根据 2021 年 12 月 1 日的行政处罚决定，中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。中国银行保险监督管理委员会对中

国银行罚款 5050 万元。

#### 4、19 上海银行二级

根据 2021 年 7 月 2 日的行政处罚决定，上海银行因：一、2018 年 12 月，该行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则；二、2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则；三、2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房；四、2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎；五、2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则；六、2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款共计 460 万元。

根据 2021 年 4 月 25 日的行政处罚决定，上海银行因未按照规定进行信息披露，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款 30 万元。

根据 2020 年 11 月 18 日的行政处罚决定，上海银行因 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则，以及 2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款共计 80 万元。

#### 5、21 建设银行小微债

根据 2021 年 8 月 13 日的行政处罚决定，因建设银行：1. 占压财政存款或者资金；2. 违反账户管理规定，被中国人民银行警告，并处罚款 388 万元。

#### 6、12 中信银行 01

根据 2021 年 3 月 17 日公布的行政处罚决定，因中信银行：一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷，被中国银行保险监督管理委员会罚款 450 万元。

根据 2021 年 2 月 5 日公布的行政处罚决定，因中信银行：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易，被中国人民银行罚款 2890 万元。

对 18 农业银行二级 01、17 工商银行二级 01、17 中国银行二级 01、19 上海银行二级、21 建设银行小微债、12 中信银行 01 的投资决策程序的说明：

本基金管理人认为，上述处罚事项未对农业银行、工商银行、中国银行、上海银行、建设银行、

中信银行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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58,417,227.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	58,417,227.03

### 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。

### 5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	3,497,290,164.01
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	461.54
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	3,497,289,702.47

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

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	20210701-20210930	3,497,281,175.86	-	-	3,497,281,175.86	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

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。

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。

## 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、《诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德安盛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、诺德安盛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

2021 年 10 月 27 日