

# 诺德安盛纯债债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	诺德安盛
基金主代码	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	3,497,284,146.70 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	23,903,942.98
2. 本期利润	14,812,095.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0042
4. 期末基金资产净值	3,720,772,716.29
5. 期末基金份额净值	1.0639

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。

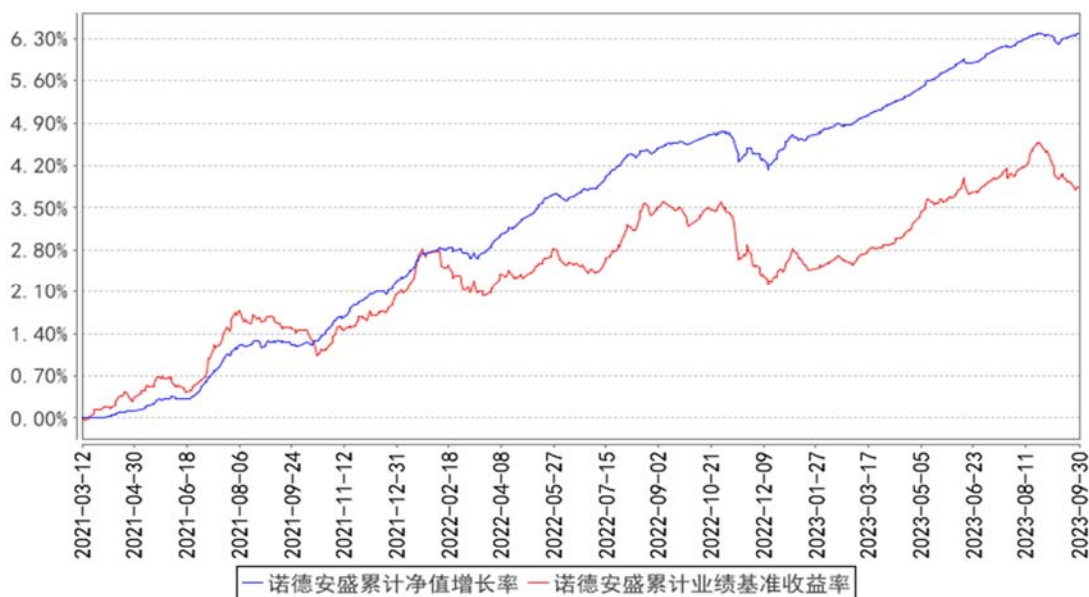
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	0.40%	0.02%	0.01%	0.05%	0.39%	-0.03%
过去六个月	1.18%	0.02%	0.95%	0.04%	0.23%	-0.02%
过去一年	1.76%	0.03%	0.62%	0.05%	1.14%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	6.39%	0.02%	3.85%	0.05%	2.54%	-0.03%

#### 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

诺德安盛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 2023 年 9 月 30 日。

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		
王宪彪	本基金基金经理、诺德短债债券型证券投资基金基金经理	2022 年 6 月 6 日	-	7 年	上海财经大学国际商务硕士。历任上海银行股份有限公司信用风险分析、浦银安盛基金管理有限公司销售经理、上海赞庚投资集团有限公司信用研究员、一默（上海）资产管理有限公司投资经理。2018 年 12 月加入诺德基金管理有限公司，担任债券研究员，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	2021 年 4 月 16 日	-	16 年	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。

	资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金的基金经理				
景辉	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、诺德安元纯债债券型证券投资基金、诺德中短债债券型证券投资基金基金经理	2021 年 3 月 12 日	-	10 年	上海财经大学金融学硕士。2005 年 2 月至 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 年三季度经济基本面仍处于复苏进程中，逆周期政策持续发力。进入三季度，央行分别在 6 月、8 月两次进行降息操作，MLF 利率从此前的 2.75% 下降至当前的 2.5%。此外，央行在 9 月份再次进行降准，精准有力实施好稳健货币政策，保持了流动性合理充裕，预计货币政策偏

宽松基调或将延续。

报告期内，本基金配置品种继续以政金债、高等级信用债和同业存单为主要投资品种，三季度资金价格有所波动，杠杆水平维持较低水平，整体净值表现平稳。

展望四季度，经济或将仍呈现继续复苏态势，伴随特殊再融资债的发行，财政政策逐步落地形成实物工作量，资金面受债券供给放量影响可能会有一定扰动，但经济复苏大背景下，货币政策仍将呵护资金面以推动经济进一步复苏，预计债券市场仍将维持震荡格局。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.0639 元，累计净值为 1.0639 元。本报告期份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准增长率为 0.01%。

#### 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	3,934,894,108.53	99.93
	其中：债券	3,814,456,662.64	96.87
	资产支持证券	120,437,445.89	3.06
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	2,724,888.86	0.07
8	其他资产	3,100.87	0.00
9	合计	3,937,622,098.26	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	3,073,491.78	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,378,512,228.15	37.05
	其中：政策性金融债	356,367,466.47	9.58
4	企业债券	173,711,867.94	4.67
5	企业短期融资券	100,046,469.95	2.69
6	中期票据	1,560,200,328.64	41.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	598,912,276.18	16.10
9	其他	-	-
10	合计	3,814,456,662.64	102.52

## 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	1920066	19 上海银行二级	2,500,000	263,123,027.40	7.07
2	1928026	19 兴业银行二级 02	2,000,000	202,956,131.15	5.45
3	112217190	22 光大银行 CD190	2,000,000	199,574,364.93	5.36
4	2128003	21 建设银行小微债	1,200,000	123,088,504.11	3.31
5	102101278	21 中铁股 MTN003	1,200,000	121,415,475.41	3.26

## 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	112895	23 和光 02	900,000	91,117,977.53	2.45
2	199622	31ZL9A1	340,000	29,319,468.36	0.79

## 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，19 兴业银行二级 02 的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）、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”）存在被监管公开处罚的情形。

#### 1、19 兴业银行二级 02

根据 2022 年 9 月 9 日的行政处罚决定，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会罚款 150 万元。

根据 2022 年 9 月 28 日的行政处罚决定，兴业银行因兴业银行理财业务存在以下违法违规行为：一、老产品规模在部分时点出现反弹；二、未按规定开展理财业务内部审计；三、同业理财产品未持续压降；四、单独使用区间数值展示业绩比较基准；五、理财托管业务违反资产独立性原则要求，被中国银行保险监督管理委员会罚款 450 万元。

根据 2023 年 6 月 14 日的行政处罚决定，兴业银行因一、衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；二、对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务；三、代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理；四、债券交易超授权；五、通过资产管理产品开展不正当交易；六、超比例投资本行主承销的债券；七、债券投资五级分类不准确；八、债券投资风险管理未独立于当地分支行；九、通过金融交易市场进行电子化交易的同业业务委托分支机构询价和项

目发起；十、市场风险资本计量严重不审慎，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 400 万元。

## 2、21 建设银行小微债

根据 2022 年 9 月 9 日的行政处罚决定，建设银行因：一、个人经营贷款挪用至房地产市场；二、个人经营贷款“三查”不到位；三、总行对分支机构管控不力承担管理责任，被中国银行保险监督管理委员会罚款 260 万元。

根据 2022 年 9 月 30 日的行政处罚决定，建设银行因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 2023 年 2 月 16 日的行政处罚决定，建设银行因：一、公司治理和内部控制制度与监管规定不符；二、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改；三、向检查组提供企业出具的虚假证明材料；四、未按规定及时报送案件信息；五、违规发放房地产贷款；六、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款；七、违规发放固定资产贷款；八、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资；九、信用卡资金违规流入证券公司；十、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资；十一、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计；十二、小微快贷业务违反审慎经营规则；十三、违规收取民营企业、小微企业费用；十四、违规借贷搭售理财产品；十五、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用；十六、向关系人发放信用贷款；十七、违规发放贷款掩盖风险；十八、违规变相突破单一法人客户授信额度限制；十九、搭桥贷款业务不合规；二十、流动资金贷款管理违反审慎经营规则；二十一、固定资产贷款管理违反审慎经营规则；二十二、并购贷款管理违反审慎经营规则；二十三、个人贷款管理严重违反审慎经营规则；二十四、理财业务风险隔离不符合监管规定；二十五、理财业务投资运作不合规；二十六、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表；二十七、违规虚增资本；二十八、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合定，违规投资权益类资产；二十九、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产；三十、理财业务统计数据与事实不符；三十一、理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求；三十二、同业投资业务管理违反审慎经营规则；三十三、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求；三十四、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险；三十五、贴现资金违规回流出票人；三十六、违规向委托贷款借款人收取手续费；三十七、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现；三十八、银行集团并表统一授信管理流于形式，被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元。其中，总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

对 19 兴业银行二级 02、21 建设银行小微债的投资决策程序的说明：

本基金管理人认为相关处罚对两家银行偿付能力影响较小，风险可控。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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,100.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,100.87

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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	3,497,298,974.41
报告期期间基金总申购份额	112.76
减：报告期期间基金总赎回份额	14,940.47
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	3,497,284,146.70

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	20230701-20230930	3,497,281,175.86	-	-	3,497,281,175.86	100.00
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

2023 年 10 月 25 日