

# 诺德安盛纯债债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 12 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| 3.3 其他指标.....                                | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13        |
| 4.8 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.....       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 15        |
| 6.2 利润表.....                                 | 16        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 17        |
| 6.4 报表附注.....                              | 18        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 41        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 41        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 41        |
| 7.6 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.....    | 42        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 42        |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 42        |
| 7.9 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.....    | 43        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 43        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 43        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 48        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 48        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>49</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 50        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 50        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 50        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 50        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 51        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>53</b> |
| 11.1 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.....   | 53        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 53        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 54        |
| 12.2 存放地点.....            | 54        |
| 12.3 查阅方式.....            | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金    |
| 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    |
| 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         |
| 报告期末基金份额总额 | 3,497,290,164.01 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 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。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                            | 基金托管人                   |
|---------|------|----------------------------------|-------------------------|
| 名称      |      | 诺德基金管理有限公司                       | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈培阳                              | 陆志俊                     |
|         | 联系电话 | 021-68985266                     | 95559                   |
|         | 电子邮箱 | peiyang.chen@nuodefund.com       | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话  |      | 400-888-0009                     | 95559                   |
| 传真      |      | 021-68985121                     | 021-62701216            |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层       | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号       |
| 邮政编码    |      | 200120                           | 200336                  |
| 法定代表人   |      | 潘福祥                              | 任德奇                     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.nuodefund.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                       |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 诺德基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年3月12日 - 2021年6月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益       | 13,703,880.79                |
| 本期利润          | 14,090,804.87                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0052                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.51%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.46%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)             |
| 期末可供分配利润      | 14,728,297.39                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0042                       |
| 期末基金资产净值      | 3,513,379,366.96             |
| 期末基金份额净值      | 1.0046                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日)             |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.46%                        |

注：

- 1、 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。
- 2、 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。
- 3、 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。
- 4、 本基金合同生效日为 2021 年 3 月 12 日。

#### 3.2 基金净值表现

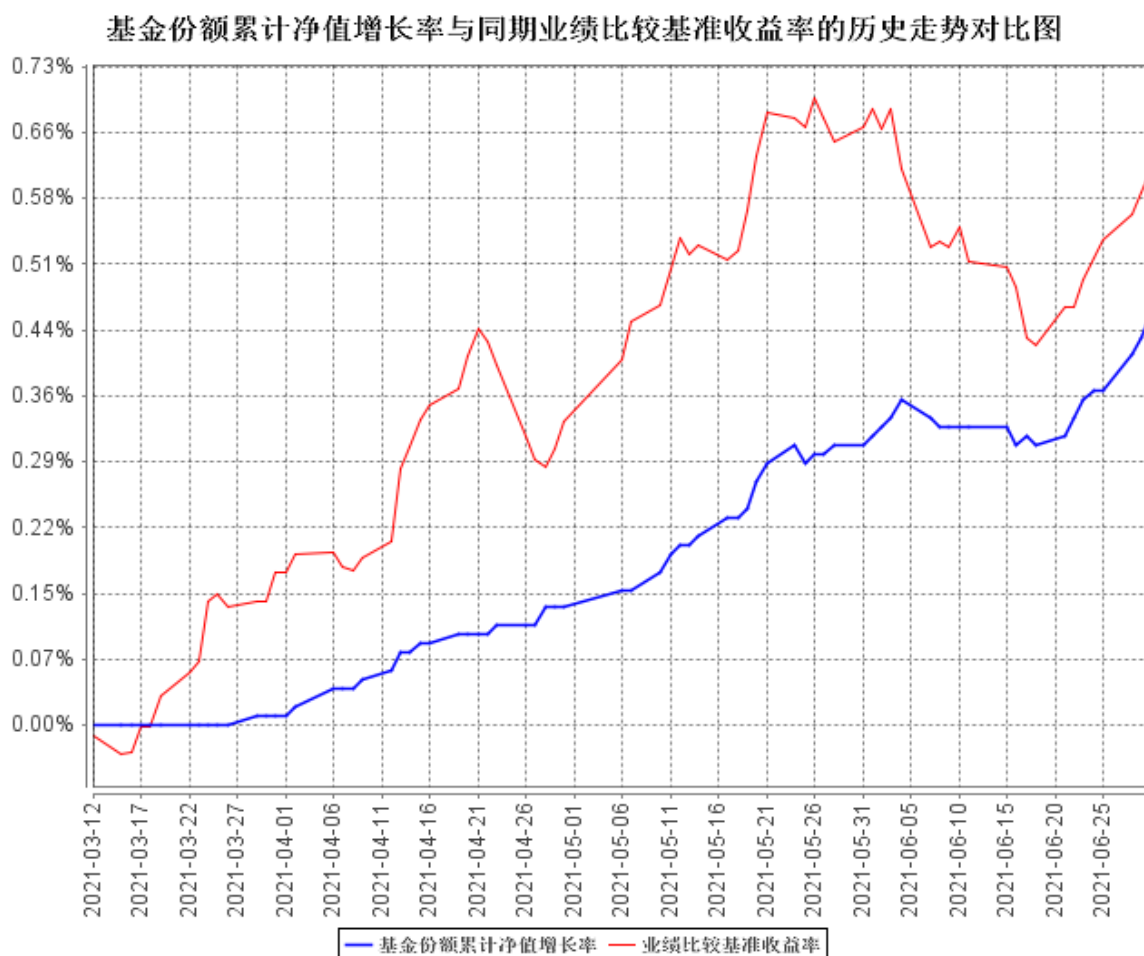
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.15%    | 0.02%       | -0.04%     | 0.03%         | 0.19%  | -0.01% |
| 过去三个月      | 0.45%    | 0.01%       | 0.45%      | 0.03%         | 0.00%  | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.46%    | 0.01%       | 0.62%      | 0.03%         | -0.16% | -0.02% |



注：本基金业绩比较基准为中债综合(全价)指数收益率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



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 6 月 30 日。

本基金成立未满 1 年。本基金的建仓期 6 个月，截止 2021 年 6 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了三十二只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                               | 任本基金的基金经理（助理）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、诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理、诺德短债 | 2021 年 3 月 12 日 | -    | 8      | 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。 |

|     |   |            |   |    |   |
|-----|---|------------|---|----|---|
|     | 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 |            |   |    |   |
| 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                    | 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。 |

|  |          |  |  |  |  |
|--|----------|--|--|--|--|
|  | 基金经<br>理 |  |  |  |  |
|--|----------|--|--|--|--|

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。

#### 4.1.3 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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内经济保持较快增长，央行保持了稳健中性的货币政策，各项政策利率保持不变，

显示了政策的连续性。债券市场资金充裕，资金面保持平稳；再加上债券市场供给压力较小，债券市场震荡上行，其中短端收益率下行更快，收益率曲线陡峭化。

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。目前组合仍在建仓期内，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0046 元，累计净值为 1.0046 元。本报告期份额净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准增长率为 0.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，市场资金面大概率将维持偏宽松的局面，而实体经济数据有望保持平稳。未来需要继续关注海内外经济及政策的边际变化对各类资产可能造成的影响。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为了确保基金估值严格执行新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，更好地保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人制定并修订了《诺德基金管理有限公司证券投资基金估值制度》（以下简称“估值制度”。）

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资研究部总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中：

基金会计主管主要负责制定新的估值政策、方法和程序，提供相关的会计数据，并具体负责和会计事务所及基金托管行就估值模型、假设及参数进行沟通，以支持委员会的相关决定；

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

投资研究部总监主要负责分析市场情况，并在结合相关行业研究员意见的基础上对具体投资品种所处的经济环境和相关重大事项进行判断；

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

根据估值制度，估值委员会成员中不包括基金经理。本报告期内，上述参与流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 4.8 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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在诺德安盛纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，诺德基金管理有限公司在诺德安盛纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由诺德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺德安盛纯债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：诺德安盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 94,829,486.74                  | -                                |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,422,785,000.00               | -                                |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 2,299,750,000.00               | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | 123,035,000.00                 | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 967,802,371.70                 | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 29,236,012.10                  | -                                |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 3,514,652,870.54               | -                                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 50.15                          | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 865,321.21                     | -                                |
| 应付托管费           |            | 288,440.43                     | -                                |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 16,957.17                      | -                                |
| 应交税费            |            | 42,531.55                      | -                                |

|               |          |                  |   |
|---------------|----------|------------------|---|
| 应付利息          |          | -                | - |
| 应付利润          |          | -                | - |
| 递延所得税负债       |          | -                | - |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 60,203.07        | - |
| 负债合计          |          | 1,273,503.58     | - |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 3,497,290,164.01 | - |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 16,089,202.95    | - |
| 所有者权益合计       |          | 3,513,379,366.96 | - |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,514,652,870.54 | - |

注：1. 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0046 元，基金份额总额 3,497,290,164.01 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：诺德安盛纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 3 月 12 日(基<br>金合同生效日)至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 17,466,781.18  | -   |
| 1.利息收入                |            | 17,079,856.20  | -   |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 3,277,079.49   | -   |
| 债券利息收入                |            | 12,477,434.44  | -   |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 1,325,342.27   | -   |
| 证券出借利息收入              |            | -  | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -  | -   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 386,924.08   | -   |



|                            |            |               |   |
|----------------------------|------------|---------------|---|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.18   | 0.90          | - |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 3,375,976.31  | - |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,471,489.17  | - |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 823,829.75    | - |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | - |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 8,675.00      | - |
| 5. 利息支出                    |            | -             | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | - |
| 6. 税金及附加                   |            | 6,774.32      | - |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 65,208.07     | - |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 14,090,804.87 | - |
| 减：所得税费用                    |            | -             | - |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 14,090,804.87 | - |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德安盛纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021年3月12日（基金合同生效日）至2021年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021年3月12日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |               |                   |
|-----------------------------------|--------------------------------------|---------------|-------------------|
|                                   | 实收基金                                 | 未分配利润         | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 203,992,589.42                       | -             | 203,992,589.42    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                    | 14,090,804.87 | 14,090,804.87     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 3,293,297,574.59                     | 1,998,398.08  | 3,295,295,972.67  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 6,994,410,010.57                     | 5,595,526.50  | 7,000,005,537.07  |
| 2. 基金赎回款                          | -3,701,112,435.98                    | -3,597,128.42 | -3,704,709,564.40 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少）   | -                                    | -             | -                 |

|  |                                 |               |                  |
|--|---------------------------------|---------------|------------------|
| 以“-”号填列)                               |                                 |               |                  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 3,497,290,164.01                | 16,089,202.95 | 3,513,379,366.96 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |               |                  |
|  | 实收基金                            | 未分配利润         | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | -                               | -             | -                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | -             | -                |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -                               | -             | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -                               | -             | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                               | -             | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                               | -             | -                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | -                               | -             | -                |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          罗凯                                          罗凯                                          高奇            
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

诺德安盛纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3505号《关于准予诺德安盛纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 203,988,509.42 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0300 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺

德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 203,992,589.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,080.00 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、超短期融资券、政府支持机构债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款和其他银行存款等）、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资股票，也不投资于可转换债券、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- （1）对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不

活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:



(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 94,829,486.74          |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 94,829,486.74          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2021年6月30日 |                  |                  |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
|                   | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票                | -                 | -                | -                |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -                | -                |
| 债券                | 交易所市场             | -                | -                |
|                   | 银行间市场             | 2,299,398,075.92 | 2,299,750,000.00 |
|                   | 合计                | 2,299,398,075.92 | 2,299,750,000.00 |
| 资产支持证券            | 123,000,000.00    | 123,035,000.00   | 35,000.00        |
| 基金                | -                 | -                | -                |
| 其他                | -                 | -                | -                |
| 合计                | 2,422,398,075.92  | 2,422,785,000.00 | 386,924.08       |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 967,802,371.70    | -         |
| 合计    | 967,802,371.70    | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 180,934.10        |
| 应收定期存款利息 | -                 |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收其他存款利息   | -             |
| 应收结算备付金利息  | -             |
| 应收债券利息     | 28,644,301.38 |
| 应收资产支持证券利息 | 186,829.60    |
| 应收买入返售证券利息 | 223,947.02    |
| 应收申购款利息    | -             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -             |
| 应收出借证券利息   | -             |
| 其他         | -             |
| 合计         | 29,236,012.10 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 16,957.17         |
| 合计          | 16,957.17         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提费用        | 60,203.07         |
| 合计          | 60,203.07         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021年6月30日 |      |
|----|--------------------------------------|------|
|    | 基金份额(份)                              | 账面金额 |
|    |                                      |      |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日       | 203,992,589.42    | 203,992,589.42    |
| 本期申购          | 6,994,410,010.57  | 6,994,410,010.57  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -3,701,112,435.98 | -3,701,112,435.98 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                 | -                 |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                 | -                 |
| 本期申购          | -                 | -                 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                 | -                 |
| 本期末           | 3,497,290,164.01  | 3,497,290,164.01  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -             | -             |
| 本期利润           | 13,703,880.79 | 386,924.08    | 14,090,804.87 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,024,416.60  | 973,981.48    | 1,998,398.08  |
| 其中：基金申购款       | 3,572,938.21  | 2,022,588.29  | 5,595,526.50  |
| 基金赎回款          | -2,548,521.61 | -1,048,606.81 | -3,597,128.42 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 14,728,297.39 | 1,360,905.56  | 16,089,202.95 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,683,468.50                         |
| 定期存款利息收入  | 348,611.12                           |
| 其他存款利息收入  | -                                    |
| 结算备付金利息收入 | -                                    |
| 其他        | 244,999.87                           |
| 合计        | 3,277,079.49                         |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021<br>年6月30日 |
|----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产                 | 386,924.08                               |
| ——股票投资                     | -  |
| ——债券投资                     | 351,924.08                               |
| ——资产支持证券投资                 | 35,000.00                                |
| ——贵金属投资                    | -  |
| ——其他                       | -  |
| 2. 衍生工具                    | -  |
| ——权证投资                     | -  |
| 3. 其他                      | -  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -  |
| 合计                         | 386,924.08                               |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021<br>年6月30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 0.90                                     |

|    |      |
|----|------|
| 合计 | 0.90 |
|----|------|

注：本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费将全额计入基金财产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021<br>年6月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | -  |
| 银行间市场交易费用 | 8,675.00                                 |
| 交易基金产生的费用 | -  |
| 其中：申购费    | -  |
| 赎回费       | -  |
| 合计        | 8,675.00                                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效日)至2021<br>年6月30日 |
|---------|--|
| 审计费用    | 22,576.29                                |
| 信息披露费   | 37,626.78                                |
| 证券出借违约金 | -  |
| 证券账户开户费 | 400.00                                   |
| 银行费用    | 4,605.00                                 |
| 合计      | 65,208.07                                |

#### 6.4.7.21 分部报告

不适用。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                    | 与本基金的关系             |
|--------------------------|---------------------|
| 诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）       | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）       | 基金托管人、基金销售机构        |
| 清华控股有限公司（“清华控股”）         | 基金管理人的股东            |
| 宜信惠民投资管理(北京)有限公司（“宜信惠民”） | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                             | 上年度可比期间              |
|-----------------|--------------------------------|----------------------|
|                 | 2021年3月12日(基金合同生效日)至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,471,489.17                   | -                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4.04                           | -                    |

注：支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年3月12日(基金合同生效<br>日)至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|--|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 823,829.75                               | -                               |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元



| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 3 月 12 日(基金合同生效日)<br>至 2021 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |        |
|-------|---|--------------|--|--------|
|       | 期末余额  | 当期利息收入       | 期末余额                                       | 当期利息收入 |
| 交通银行  | 94,829,486.74                                       | 2,683,468.50 | -  | -      |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金未持有转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理型债券型基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括

债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：(1)决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；(2)执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3)监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、稽核风控部组成。各自监督的内容和对对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 40,024,000.00          | -                        |
| 合计     | 40,024,000.00          | -                        |

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 1,837,545,000.00       | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 422,181,000.00         | -                        |
| 合计     | 2,259,726,000.00       | -                        |

注：未评级部分为政策性金融债、中期票据。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 123,035,000.00         | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 123,035,000.00         | -                        |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数

构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021<br>年6<br>月<br>30<br>日 | 1个月以内            | 1-3<br>个月 | 3个月-1年         | 1-5年           | 5年以上             | 不计息           | 合计               |
|-----------------------------------|------------------|-----------|----------------|----------------|------------------|---------------|------------------|
| 资产                                |                  |           |                |                |                  |               |                  |
| 银行存款                              | 94,829,486.74    | -         | -              | -              | -                | -             | 94,829,486.74    |
| 交易性金融资产                           | -                | -         | 432,735,000.00 | 877,157,000.00 | 1,112,893,000.00 | -             | 2,422,785,000.00 |
| 买入返售金融资产                          | 967,802,371.70   | -         | -              | -              | -                | -             | 967,802,371.70   |
| 应收利息                              | -                | -         | -              | -              | -                | 29,236,012.10 | 29,236,012.10    |
| 资产总计                              | 1,062,631,858.44 | -         | 432,735,000.00 | 877,157,000.00 | 1,112,893,000.00 | 29,236,012.10 | 3,514,652,870.54 |
| 负债                                |                  |           |                |                |                  |               |                  |
| 应付赎回款                             | -                | -         | -              | -              | -                | 50.15         | 50.15            |
| 应付管理人报酬                           | -                | -         | -              | -              | -                | 865,321.21    | 865,321.21       |
| 应付托管费                             | -                | -         | -              | -              | -                | 288,440.43    | 288,440.43       |
| 应付交易费用                            | -                | -         | -              | -              | -                | 16,957.17     | 16,957.17        |
| 应交税费                              | -                | -         | -              | -              | -                | 42,531.55     | 42,531.55        |
| 其他                                | -                | -         | -              | -              | -                | 60,203.07     | 60,203.07        |

|   |                  |                 |                |                  |               |                  |              |
|---|------------------|-----------------|----------------|------------------|---------------|------------------|--------------|
| 负债  |                  |                 |                |                  |               |                  |              |
| 负债<br>总计                                    | -                | -               | -              | -                | -             | 1,273,503.58     | 1,273,503.58 |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口                         | 1,062,631,858.44 | -432,735,000.00 | 877,157,000.00 | 1,112,893,000.00 | 27,962,508.52 | 3,513,379,366.96 |              |
| 上年<br>度末<br>2020<br>年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1 个月以内           | 1-3<br>个<br>月   | 3 个月-1 年       | 1-5 年            | 5 年以上         | 不计息              | 合计           |
| 资产  |                  |                 |                |                  |               |                  |              |
| 资产<br>总计                                    | -                | -               | -              | -                | -             | -                | -            |
| 负债  |                  |                 |                |                  |               |                  |              |
| 负债<br>总计                                    | -                | -               | -              | -                | -             | -                | -            |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口                         | -                | -               | -              | -                | -             | -                | -            |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|----|--------------------|---------------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2021 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 20,805,969.04                   | -                      |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -20,502,515.21                  |                        |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### **6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 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            | 2,422,785,000.00 | 68.93         |
|    | 其中：债券             | 2,299,750,000.00 | 65.43         |
|    | 资产支持证券            | 123,035,000.00   | 3.50          |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | 967,802,371.70   | 27.54         |
|    | 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      | 94,829,486.74    | 2.70          |
| 8  | 其他各项资产            | 29,236,012.10    | 0.83          |
| 9  | 合计                | 3,514,652,870.54 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,697,872,000.00 | 48.33         |
|    | 其中：政策性金融债 | 212,030,000.00   | 6.03          |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | 601,878,000.00   | 17.13         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 2,299,750,000.00 | 65.46         |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称         | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 1728017   | 17 中国银行二级 01 | 3,300,000 | 337,095,000.00 | 9.59          |
| 2  | 1728021   | 17 工商银行二级 01 | 3,300,000 | 336,963,000.00 | 9.59          |
| 3  | 1828002   | 18 农业银行二级 01 | 3,300,000 | 336,765,000.00 | 9.59          |
| 4  | 102100967 | 21 电网 MTN003 | 2,500,000 | 250,175,000.00 | 7.12          |
| 5  | 170206    | 17 国开 06     | 1,700,000 | 172,006,000.00 | 4.90          |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 136040 | 铁建 Y10A  | 700,000 | 70,035,000.00 | 1.99          |
| 2  | 189597 | 21 电建 3A | 500,000 | 50,000,000.00 | 1.42          |
| 3  | 189549 | G3 电建 3A | 30,000  | 3,000,000.00  | 0.09          |

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.2 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持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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 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”）、17 工商银行二级 01 的发行主体宁波中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）、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”）、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”）、21 浦发银行 01 的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）存在被监管公开处罚的情形。

#### 1、17 中国银行二级 01

根据 2021 年 5 月 17 日的行政处罚决定，中国银行因：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 2020 年 12 月 1 日的行政处罚决定，中国银行因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为：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，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币 5050 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、18 农业银行二级 01

根据 2021 年 1 月 19 日的行政处罚决定，农业银行因：（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，农业银行因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。

根据 2020 年 7 月 13 日的行政处罚决定，农业银行因：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件，被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。

### 4、21 建设银行小微债

根据 2020 年 7 月 13 日的行政处罚决定，建设银行因：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保，被中国银行保险监督管理委员会罚款合计 3920

万元。

#### 5、12 中信银行 01

根据 2021 年 3 月 17 日的行政处罚决定，中信银行因：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 日的行政处罚决定，中信银行因：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。

#### 6、21 浦发银行 01

根据 2021 年 4 月 23 日的行政处罚决定，浦发银行因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务，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 760 万元。

根据 2020 年 8 月 10 日的行政处罚决定，浦发银行因 2013 年至 2018 年存在下列违法违规事实：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务，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 2100 万元。

对 17 中国银行二级 01、17 工商银行二级 01、18 农业银行二级 01、21 建设银行小微债、12 中信银行 01、21 浦发银行 01 的投资决策程序的说明：本基金管理人认为，上述处罚事项未对中国银行、工商银行、农业银行、建设银行、中信银行、浦发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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 29,236,012.10 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 29,236,012.10 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |            |          |            |
|--------------|---------------|------------------|------------|----------|------------|
|              |               | 机构投资者            |            | 个人投资者    |            |
|              |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额     | 占总份<br>额比例 |
| 304          | 11,504,243.96 | 3,497,281,175.86 | 100.00%    | 8,989.15 | 0.00%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 4.95      | 0.00%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021年3月12日）基金份额总额          | 203,992,589.42   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 6,994,410,010.57 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 3,701,112,435.98 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 3,497,290,164.01 |

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 本报告期内，基金管理人无重大人事变动。  
 (2) 本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2021 年度的基金审计机构，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任过本基金募集的验资机构，提供过相关服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 海通证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东海证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证监会的有关规定，基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家证券公司租用了基金交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全、在业内有良好的声誉；  
 (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;

2、基金专用交易单元的选择程序如下:

(1)基金管理人根据上述标准考察后,确定选用交易单元的证券经营机构;

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本报告期内基金管理人新租交易单元:东海证券,退租交易单元:无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 海通证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东海证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                 | 法定披露方式       | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------------|--------------|------------|
| 1  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告       | 证券时报、指定互联网网站 | 2021年3月3日  |
| 2  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告              | 证券时报、指定互联网网站 | 2021年3月3日  |
| 3  | 诺德安盛纯债债券型基金招募说明书                     | 指定互联网网站      | 2021年3月3日  |
| 4  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金产品资料概要                | 指定互联网网站      | 2021年3月3日  |
| 5  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金托管协议                  | 指定互联网网站      | 2021年3月3日  |
| 6  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同                  | 指定互联网网站      | 2021年3月3日  |
| 7  | 诺德基金管理有限公司关于诺德安盛纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告 | 证券时报、指定互联网网站 | 2021年3月11日 |
| 8  | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告              | 证券时报、指定互联网网站 | 2021年3月13日 |

|    |  |              |                 |
|----|--|--------------|-----------------|
| 9  | 诺德基金管理有限公司关于诺德安盛纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告  | 证券时报、指定互联网网站 | 2021 年 3 月 20 日 |
| 10 | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告                              | 证券时报、指定互联网网站 | 2021 年 4 月 16 日 |
| 11 | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金招募说明书更新提示性公告                          | 证券时报、指定互联网网站 | 2021 年 4 月 21 日 |
| 12 | 诺德安盛纯债债券型基金招募说明书（更新）（2021 年 4 月）                     | 指定互联网网站      | 2021 年 4 月 21 日 |
| 13 | 诺德安盛纯债债券型证券投资基金产品资料概要（更新）20210421                    | 指定互联网网站      | 2021 年 4 月 21 日 |
| 14 | 诺德基金管理有限公司关于诺德安盛纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 证券时报、指定互联网网站 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 15 | 诺德基金管理有限公司关于调整微信网上直销业务优惠费率的公告                        | 四大报、指定互联网网站  | 2021 年 4 月 22 日 |
| 16 | 诺德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告                          | 四大报、指定互联网网站  | 2021 年 4 月 24 日 |

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20210312<br>-<br>20210630 | 100,001,000.00 | 3,397,280,175.86 | -                | 3,497,281,175.86 | 100.00% |
|       | 2              | 20210414<br>-<br>20210421 | -              | 1,998,400,279.78 | 1,998,400,279.78 | 0.00             | 0.00%   |
|       | 3              | 20210312<br>-<br>20210322 | 50,000,000.00  | -                | 50,000,000.00    | 0.00             | 0.00%   |
|       | 4              | 20210414<br>-<br>20210420 | -              | 1,498,800,959.23 | 1,498,800,959.23 | 0.00             | 0.00%   |
| 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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 2021 年中期报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

### 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：<http://www.nuodefund.com>。

### 12.3 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 8 月 28 日