

2017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：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：2017年10月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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。

基金管理人的董事会及监事会对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、完整性承担个别及连带责任。

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该基金的招募说明书。

本报告公告的财务数据未经审计。

## § 2 基金产品概况

基金简称：诺德天禧债券型证券投资基金

场内简称：-

基金代码：003101

交易场所：深圳证券交易所

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年8月15日

报告期末基金份额总额：197,697,824.74份

## § 3 投资目标

本基金的管理人在充分控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力求实现基金资产的稳定增值。

本基金通过对宏观经济形势及政策的深入分析，形成对利率和债券类资产的判断，从而制定相应的投资策略，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。

本基金投资组合比例：股票资产占基金总资产的比例不超过5%，其中，固定收益类资产占基金总资产的比例不低于80%；现金类资产占基金总资产的比例不高于20%；权证、股指期货、国债期货等金融衍生品占基金总资产的比例不高于5%；其余资产投资于货币市场基金。

报告期末基金份额总额：197,697,824.74份

## § 4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的管理人在充分控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力求实现基金资产的稳定增值。

本基金通过对宏观经济形势及政策的深入分析，形成对利率和债券类资产的判断，从而制定相应的投资策略，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。

本基金投资组合比例：股票资产占基金总资产的比例不超过5%，其中，固定收益类资产占基金总资产的比例不低于80%；现金类资产占基金总资产的比例不高于20%；权证、股指期货、国债期货等金融衍生品占基金总资产的比例不高于5%；其余资产投资于货币市场基金。

报告期末基金份额总额：197,697,824.74份

## § 5 报告期内基金的业绩表现

本基金的管理人在充分控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力求实现基金资产的稳定增值。

本基金通过对宏观经济形势及政策的深入分析，形成对利率和债券类资产的判断，从而制定相应的投资策略，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。

本基金投资组合比例：股票资产占基金总资产的比例不超过5%，其中，固定收益类资产占基金总资产的比例不低于80%；现金类资产占基金总资产的比例不高于20%；权证、股指期货、国债期货等金融衍生品占基金总资产的比例不高于5%；其余资产投资于货币市场基金。

报告期末基金份额总额：197,697,824.74份

## § 6 价差表现

本基金的管理人在充分控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力求实现基金资产的稳定增值。

本基金通过对宏观经济形势及政策的深入分析，形成对利率和债券类资产的判断，从而制定相应的投资策略，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。

本基金投资组合比例：股票资产占基金总资产的比例不超过5%，其中，固定收益类资产占基金总资产的比例不低于80%；现金类资产占基金总资产的比例不高于20%；权证、股指期货、国债期货等金融衍生品占基金总资产的比例不高于5%；其余资产投资于货币市场基金。

报告期末基金份额总额：197,697,824.74份

## § 7 基金管理人

诺德基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

## § 8 主要财务指标

主要财务指标 单位：人民币元 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 1,509,951.59

2.本期利润 2,879,115.34

3.期初平均基金份额净值 0.0078

4.期末基金份额净值 198,750,782.61

5.期末基金净值收益率 -0.0053

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可能低于所列数字。  
2.本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）加上本期利润，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.本期利润是指基金利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除必要的费用后的余额。  
4.期末基金净值收益率=（期末基金份额净值-期初基金份额净值）/期初基金份额净值。  
5.期末基金净值=基金资产净值/基金份额总数。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 1,509,951.59

2.本期利润 2,879,115.34

3.期初平均基金份额净值 0.0078

4.期末基金份额净值 198,750,782.61

5.期末基金净值收益率 -0.0053

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可能低于所列数字。  
2.本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）加上本期利润，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.本期利润是指基金利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除必要的费用后的余额。  
4.期末基金净值收益率=（期末基金份额净值-期初基金份额净值）/期初基金份额净值。  
5.期末基金净值=基金资产净值/基金份额总数。

3.2 本期报告期基金累计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(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.3 2017年第三季度基金累计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(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.4 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.5 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.6 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.7 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.8 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.9 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.10 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.11 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.12 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.13 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.14 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.15 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.16 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.17 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.18 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.19 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.20 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.21 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.22 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.23 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.29% 0.11%

3.24 2017年第三季度基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 收益率差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.92% 0.14% 0.85% 0.03% 0.