

诺德天禧债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

<p>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</p> <p>§1 重要提示</p> <p>基金管理人及董事承诺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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本报告中所指财务数据未经审计。</p> <p>本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。</p> <p>§2 基金产品概况</p> <table> <tr><td>基金简称</td><td>诺德天禧</td></tr> <tr><td>场内简称</td><td></td></tr> <tr><td>基金代码</td><td>001031</td></tr> <tr><td>交易代码</td><td>001031</td></tr> <tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr> <tr><td>基金合同生效日</td><td>2016年8月15日</td></tr> <tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>197,697,824.74份</td></tr> <tr><td>投资目标</td><td>本基金在严格控制风险并兼顾资产流动性的前提下,通过积极灵活的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。</td></tr> <tr><td>投资策略</td><td>本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。</td></tr> <tr><td>业绩比较基准</td><td>中证综合债券指数收益率</td></tr> <tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。</td></tr> <tr><td>基金管理人</td><td>诺德基金管理有限公司</td></tr> <tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr> </table>		基金简称	诺德天禧	场内简称		基金代码	001031	交易代码	001031	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	投资目标	本基金在严格控制风险并兼顾资产流动性的前提下,通过积极灵活的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。	投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。	业绩比较基准	中证综合债券指数收益率	风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。	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
基金简称	诺德天禧																										
场内简称																											
基金代码	001031																										
交易代码	001031																										
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																										
投资目标	本基金在严格控制风险并兼顾资产流动性的前提下,通过积极灵活的资产配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。																										
投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。																										
业绩比较基准	中证综合债券指数收益率																										
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。																										
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																										

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	1,500,959.16
2.本期利润	2,876,115.34
3.期末可供基金份额持有人分配利润	0.0078
4.期末基金资产净值	198,750,782.61
5.期末基金份额净值	1.0053

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 本报告期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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	①-④
过去三个月	0.02%	0.14%	0.03%	0.03%	0.02%	0.11%

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

诺德天禧债券型证券投资基金基金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

<p>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</p> <p>§1 重要提示</p> <p>基金管理人及董事承诺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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本报告中所指财务数据未经审计。</p> <p>本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。</p> <p>§2 基金产品概况</p> <table> <tr><td>基金简称</td><td>诺德天禧30</td></tr> <tr><td>场内简称</td><td></td></tr> <tr><td>基金代码</td><td>570007</td></tr> <tr><td>交易代码</td><td>570007</td></tr> <tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr> <tr><td>基金合同生效日</td><td>2011年5月5日</td></tr> <tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>48,014,784.16份</td></tr> <tr><td>投资目标</td><td>本基金重点关注具备高成长能力和行业龙头个股,在严格控制风险的前提下,通过集中投资于具有成长性和完整性的科技类资产,谋求基金资产的长期增值。</td></tr> <tr><td>投资策略</td><td>本基金秉承长期投资和价值投资的理念,在充分分散和个股之间寻求一种平衡,精选估值合理且成长性、行业景气度良好,并具备未来成长潜力的个股,长期持有并动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。</td></tr> <tr><td>业绩比较基准</td><td>沪深300指数×80%+中债综合财富指数×20%</td></tr> <tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为混合型平衡基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益和预期收益平衡型证券投资基金品种。</td></tr> <tr><td>基金管理人</td><td>诺德基金管理有限公司</td></tr> <tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr> </table>		基金简称	诺德天禧30	场内简称		基金代码	570007	交易代码	570007	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2011年5月5日	报告期末基金份额总额	48,014,784.16份	投资目标	本基金重点关注具备高成长能力和行业龙头个股,在严格控制风险的前提下,通过集中投资于具有成长性和完整性的科技类资产,谋求基金资产的长期增值。	投资策略	本基金秉承长期投资和价值投资的理念,在充分分散和个股之间寻求一种平衡,精选估值合理且成长性、行业景气度良好,并具备未来成长潜力的个股,长期持有并动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。	业绩比较基准	沪深300指数×80%+中债综合财富指数×20%	风险收益特征	本基金为混合型平衡基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益和预期收益平衡型证券投资基金品种。	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
基金简称	诺德天禧30																										
场内简称																											
基金代码	570007																										
交易代码	570007																										
基金运作方式	契约型开放式																										
基金合同生效日	2011年5月5日																										
报告期末基金份额总额	48,014,784.16份																										
投资目标	本基金重点关注具备高成长能力和行业龙头个股,在严格控制风险的前提下,通过集中投资于具有成长性和完整性的科技类资产,谋求基金资产的长期增值。																										
投资策略	本基金秉承长期投资和价值投资的理念,在充分分散和个股之间寻求一种平衡,精选估值合理且成长性、行业景气度良好,并具备未来成长潜力的个股,长期持有并动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。																										
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中债综合财富指数×20%																										
风险收益特征	本基金为混合型平衡基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益和预期收益平衡型证券投资基金品种。																										
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																										

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	6,805,904.80
2.本期利润	2,519,852.60
3.期末可供基金份额持有人分配利润	0.0094
4.期末基金资产净值	69,891,464.02
5.期末基金份额净值	1.456

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 本报告期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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	①-④
过去三个月	3.48%	0.50%	3.74%	0.47%	-0.26%	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

诺德天禧30混合型证券投资基金基金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

<p>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</p> <p>§1 重要提示</p> <p>基金管理人及董事承诺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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本报告中所指财务数据未经审计。</p> <p>本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。</p> <p>§2 基金产品概况</p> <table> <tr><td>基金简称</td><td>诺德增强收益债券</td></tr> <tr><td>场内简称</td><td></td></tr> <tr><td>基金代码</td><td>570003</td></tr> <tr><td>交易代码</td><td>570003</td></tr> <tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr> <tr><td>基金合同生效日</td><td>2009年3月14日</td></tr> <tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>456,336,560.05份</td></tr> <tr><td>投资目标</td><td>本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。</td></tr> <tr><td>投资策略</td><td>本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。</td></tr> <tr><td>业绩比较基准</td><td>中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%</td></tr> <tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。</td></tr> <tr><td>基金管理人</td><td>诺德基金管理有限公司</td></tr> <tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr> </table>		基金简称	诺德增强收益债券	场内简称		基金代码	570003	交易代码	570003	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2009年3月14日	报告期末基金份额总额	456,336,560.05份	投资目标	本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。	投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。	业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。	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
基金简称	诺德增强收益债券																										
场内简称																											
基金代码	570003																										
交易代码	570003																										
基金运作方式	契约型开放式																										
基金合同生效日	2009年3月14日																										
报告期末基金份额总额	456,336,560.05份																										
投资目标	本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。																										
投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。																										
业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%																										
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。																										
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																										

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	-2,960,632.51
2.本期利润	5,153,762.27
3.期末可供基金份额持有人分配利润	0.0112
4.期末基金资产净值	484,062,134.21
5.期末基金份额净值	1.061

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 本报告期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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	①-④
过去三个月	1.05%	0.12%	0.09%	0.08%	0.05%	0.05%

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

诺德增强收益债券型证券投资基金基金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

<p>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</p> <p>§1 重要提示</p> <p>基金管理人及董事承诺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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本报告中所指财务数据未经审计。</p> <p>本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。</p> <p>§2 基金产品概况</p> <table> <tr><td>基金简称</td><td>诺德天禧增强收益</td></tr> <tr><td>场内简称</td><td></td></tr> <tr><td>基金代码</td><td>570003</td></tr> <tr><td>交易代码</td><td>570003</td></tr> <tr><td>基金运作方式</td><td>契约型开放式</td></tr> <tr><td>基金合同生效日</td><td>2009年3月14日</td></tr> <tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>456,336,560.05份</td></tr> <tr><td>投资目标</td><td>本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。</td></tr> <tr><td>投资策略</td><td>本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。</td></tr> <tr><td>业绩比较基准</td><td>中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%</td></tr> <tr><td>风险收益特征</td><td>本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。</td></tr> <tr><td>基金管理人</td><td>诺德基金管理有限公司</td></tr> <tr><td>基金托管人</td><td>中国银行股份有限公司</td></tr> </table>		基金简称	诺德天禧增强收益	场内简称		基金代码	570003	交易代码	570003	基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2009年3月14日	报告期末基金份额总额	456,336,560.05份	投资目标	本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。	投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。	业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。	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
基金简称	诺德天禧增强收益																										
场内简称																											
基金代码	570003																										
交易代码	570003																										
基金运作方式	契约型开放式																										
基金合同生效日	2009年3月14日																										
报告期末基金份额总额	456,336,560.05份																										
投资目标	本基金为主动管理的债券型基金,主要通过全国银行间债券市场和交易所债券市场,在严格控制风险和追求资产增值的基础上,力争取得资本长期增值。																										
投资策略	本基金坚持通过研究分析国内外宏观经济形势发展态势、政府政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券资产风险溢价趋势的判断,并在此基础上通过对各种债券品种进行期限结构分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和利率变化等因素进行择时,主动构建和动态调整投资组合,在严格控制风险的基础上,力争取得资本长期增值,同时使债券资产保持持续稳定的增值态势,从而达到控制投资风险、长期稳健获取债券投资收益的目的。																										
业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深300指数收益率×10%																										
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。																										
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																										

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	-2,960,632.51
2.本期利润	5,153,762.27
3.期末可供基金份额持有人分配利润	0.0112
4.期末基金资产净值	484,062,134.21
5.期末基金份额净值	1.061

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 本报告期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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	①-④
过去三个月	1.05%	0.12%	0.09%	0.08%	0.05%	0.05%

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

诺德天禧增强收益债券型证券投资基金基金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

诺德天禧债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:本基金的合同于2016年8月15日生效,图示时间段为2016年8月15日至2017年9月30日。本基金建仓期为2016年8月15日至2017年2月14日,报告期结束资产配置比例符合本基金合同规定。

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间	证券从业年限	说明
杨绍清	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、诺德天禧债券型证券投资基金基金经理、诺德天禧增强收益债券型证券投资基金基金经理	2016年8月15日	10	上海财经大学金融学学士,2006年11月至2008年10月,任诺德基金管理有限公司研究员;2008年10月加入诺德基金管理有限公司,先后担任研究员、固定收益研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任公司固定收益基金经理。
朱松	本基金基金经理及诺德天禧增强收益债券型证券投资基金基金经理	2016年11月16日	9	大连理工大学工商管理硕士,2007年8月至2009年10月,任诺德基金管理有限公司研究员;2009年10月加入诺德基金管理有限公司,先后担任研究员、固定收益研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任公司固定收益基金经理。

注:1.对基金的聘任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日;解聘基金经理,其“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。

4.2 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 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机制,确保不同基金在买同一证券、按照比例分配的原则在基金公平分配交易量。公司交易系统使用公平交易模块,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向同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分析,该办法规范异常交易的类型、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得到有效执行。本报告期内,本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易,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

2017年第三季度债券市场维持弱势,其中7月下旬和8月下旬两次下跌幅度较大,7月金融工作会议提出要把主动防范化解系统性金融风险放在更重要的位置,意味着金融监管仍在加强过程中,货币政策稳健中性,资金面保持紧平衡;3季度整个债券市场的资金面保持偏紧状态,以同业存单—发行利率为代表的短期债券收益率水平居高不下,隔夜利率不断上调,对整个市场收益率形成较大冲击。债券一级市场取得发行情况较为常见。

第三季度本基金在债券方面重点配置了短久期、高评级的信用品种的资产配置力度,以获取票息为主要收益来源,同时,减持了组合中长期较长期信用品种的持仓比例。另一方面,股票资产仓位较为稳定,对组合收益贡献有限。报告期内本基金整体业绩比较基准是债券组合久期长期化,票息收益较高。

展望2017年4季度,金融监管加强仍在持续,前期在制定过程中的监管细则可能对市场、债券市场调整可能还未到位,仍需进一步等待市场环境的好转。另外,美联储4季度加息预期较高,这也在一定程度上制约国内债市的表现。

4.5 报告期内基金的投资表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.0053元,累计净值为1.0053元,本报告期份额净值增长率为0.02%,同期业绩比较基准增长率为0.03%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

截至2017年9月30日,本基金资产净值未触发预警,持有人人数未触发预警。

4.7 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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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

基金管理人及董事承诺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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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

基金管理人及董事承诺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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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

基金管理人及董事承诺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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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

基金管理人及董事承诺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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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

基金管理人及董事承诺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。

本报告中所指财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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