

诺德增强收益债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 诺德增强收益债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 573003 |
| 交易代码 | 573003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009 年 3 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 234,053,115.23 份 |
| 投资目标 | 本基金为主动式管理的债券型基金，主要通过全面投资于各类债券品种，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，为基金份额持有人获得较好的全面投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系，形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期，并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析，综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素，主动构建和调整投资组合，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资收益的目的。</p> <p>本基金对非债券产品的直接投资首选在一级市场上的新股申购（含增发），如果新股的收益率降低，根据风险和收益的配比原则，本基金将参与二级市场的</p> |

| | |
|--------|--|
| | 股票买卖。 |
| 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，其预期风险与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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2021 年 10 月 1 日 — 2021 年 12 月 31 日) |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | 1,553,355.28 |
| 2. 本期利润 | 3,591,733.21 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0150 |
| 4. 期末基金资产净值 | 251,127,752.13 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.073 |

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

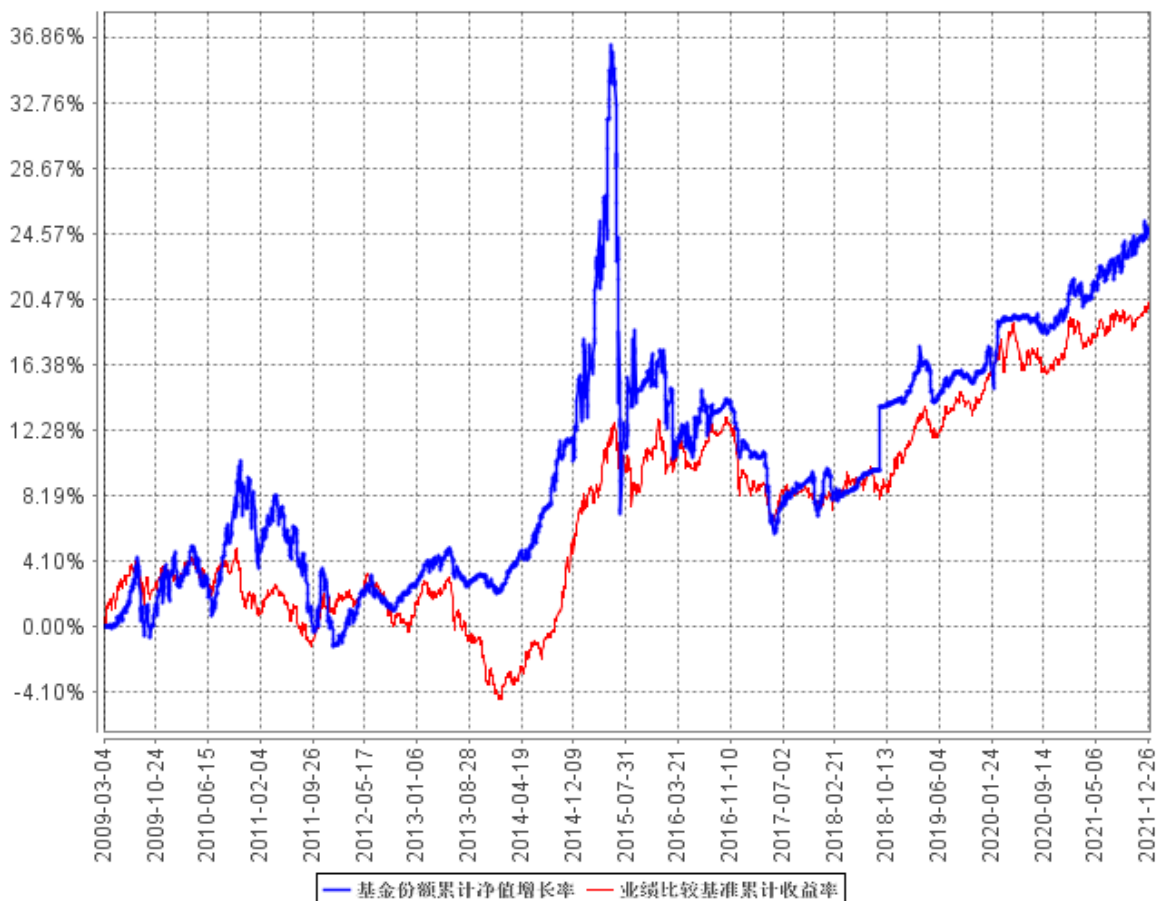
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.42% | 0.22% | 0.86% | 0.10% | 0.56% | 0.12% |
| 过去六个月 | 2.00% | 0.23% | 1.32% | 0.13% | 0.68% | 0.10% |
| 过去一年 | 3.67% | 0.20% | 1.66% | 0.14% | 2.01% | 0.06% |
| 过去三年 | 9.48% | 0.17% | 8.76% | 0.14% | 0.72% | 0.03% |
| 过去五年 | 12.30% | 0.19% | 9.60% | 0.14% | 2.70% | 0.05% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 24.97% | 0.35% | 20.38% | 0.17% | 4.59% | 0.18% |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2009 年 3 月 4 日，图示时间段为 2009 年 3 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日。

本基金建仓期为 2009 年 3 月 4 日至 2009 年 9 月 3 日。报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 景辉 | 本基金基金经理、诺德短债债券型证券投资基金基金经理、诺德安盈纯债债券型证券投资基金基金经理、诺德安瑞39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金基金经理、诺德安盛纯债债券型证券投资基金基金经理 | 2018年6月22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。 |
| 郝旭东 | 本基金基金经理、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德成长精选灵活配置混合 | 2019年8月8日 | - | 13 | 上海交通大学博士。2011年1月起加入诺德基金管理有限公司，在投资研究部从事投资管理相关工作，担任行业研究员，曾任职于西部证券股份有限公司，担任高级研究员，具有基金 |

| | | | | | |
|-------------|---|-----------------|---|----|---|
| | 型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金和诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理 | | | | 从业资格。 |
| Yi Xie (谢屹) | 本基金基金经理、诺德品质消费 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理 | 2021 年 11 月 4 日 | - | 11 | 德国慕尼黑工业大学经济与金融数学硕士。历任汇丰银行(德国)股票研究所及投资银行部分析师、高级分析师、副总裁,前海开源基金管理有限公司执行投资总监(ED),基金经理。2021 年 6 月加入诺德基金管理有限公司,担任投资三部投资总监,具有基金从业资格。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日；除首任基金经理外，“任职日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期；“离任日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。此外，本基金管理人还建立了公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年四季度，我们首先在权益部分引入了具有成长性的板块和个股。因为我们认为中国经济依然有相对较高的成长性，虽然新旧成长动力可能会逐步切换，但是这不影响我们能够找到大量优秀的具备中高业绩增速的企业。其次，我们逐步加大权益仓位，到了接近 20% 上限的位置，主要也是因为我们能够找到足够多优秀的标的，其长期收益我们认为是会好过持有固定收益类的资产和现金的，且当前估值也较为合理。债券部分，基于对未来经济复苏的判断，我们主要控制了久期，并且主要配置了利率债。未来，我们会密切关注经济的运行，在复苏确认以后增加固定收益部分的风险收益。

展望 2022 年，我们认为中国经济周期性的放缓已经进入尾声，政策层面对实体经济的提振措施非常明显。未来 1 到 2 年，国内经济会进入持续复苏向上的过程，并且预计将显著好于海外经济体，这是基本面复苏叠加政策支持的结果。证券市场上，我们认为会与 2021 年仅个别赛道获得较好收益的情况不同，明年的投资机会大概率会是全行业的，因为这是经济整体的复苏，而不是一两个行业的景气度提升。我们认为当前应该对市场保持充分的乐观，并且应该对中国经济基本

面长期向好的趋势保持充分的信心。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.073 元，累计净值为 1.238 元。本报告期份额净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准增长率为 0.86%。

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 | 45,491,331.95 | 18.07 |
| | 其中：股票 | 45,491,331.95 | 18.07 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 201,847,295.80 | 80.19 |
| | 其中：债券 | 201,847,295.80 | 80.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 1,044,253.95 | 0.41 |
| 8 | 其他资产 | 3,324,216.88 | 1.32 |
| 9 | 合计 | 251,707,098.58 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 39,839,004.47 | 15.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 4,072,575.48 | 1.62 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,579,752.00 | 0.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 45,491,331.95 | 18.11 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601058 | 赛轮轮胎 | 299,814 | 4,434,249.06 | 1.77 |
| 2 | 002241 | 歌尔股份 | 59,434 | 3,215,379.40 | 1.28 |
| 3 | 600426 | 华鲁恒升 | 95,068 | 2,975,628.40 | 1.18 |
| 4 | 603899 | 晨光文具 | 36,683 | 2,366,420.33 | 0.94 |
| 5 | 603733 | 仙鹤股份 | 55,900 | 2,281,279.00 | 0.91 |
| 6 | 002557 | 洽洽食品 | 36,152 | 2,218,286.72 | 0.88 |
| 7 | 600298 | 安琪酵母 | 36,036 | 2,175,132.96 | 0.87 |
| 8 | 601336 | 新华保险 | 53,153 | 2,066,588.64 | 0.82 |
| 9 | 002142 | 宁波银行 | 52,403 | 2,005,986.84 | 0.80 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 16,400 | 1,938,152.00 | 0.77 |
|----|--------|------|--------|--------------|------|

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 | 7,730,696.00 | 3.08 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 181,102,000.00 | 72.12 |
| | 其中：政策性金融债 | 160,893,000.00 | 64.07 |
| 4 | 企业债券 | 280,800.00 | 0.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 12,733,799.80 | 5.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 201,847,295.80 | 80.38 |

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 | 210402 | 21 农发 02 | 700,000 | 70,917,000.00 | 28.24 |
| 2 | 210206 | 21 国开 06 | 400,000 | 40,028,000.00 | 15.94 |
| 3 | 210211 | 21 国开 11 | 200,000 | 19,982,000.00 | 7.96 |
| 3 | 210411 | 21 农发 11 | 200,000 | 19,982,000.00 | 7.96 |
| 4 | 2128030 | 21 交通银行二级 | 100,000 | 10,169,000.00 | 4.05 |
| 5 | 2128027 | 21 招商银行小微债 03 | 100,000 | 10,040,000.00 | 4.00 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，21 交通银行二级的发行主体交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）、上银转债的发行主体上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）、21 招商银行小微债 03 的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）存在被监管公开处罚的情形。

1、21 交通银行二级

根据 2021 年 8 月 13 日的行政处罚决定，因交通银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行罚款 62 万元。

根据 2021 年 7 月 13 日的行政处罚决定，因交通银行：（一）理财业务和同业业务制度不健全；（二）理财业务数据与事实不符；（三）部分理财业务发展与监管导向不符；（四）理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；（五）理财资金违规投向土地储备项目；（六）理财产品相互交易调节收益；（七）面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；（八）公募理财产品投资单只证券超限额；（九）理财资金违规投向交易所上市交易的股票；（十）理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位；（十一）私募理财产品销售文件未约定冷静期；（十二）开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求；（十三）理

财产品信息登记不及时；（十四）理财产品信息披露不合规；（十五）同业业务交易对手名单调整不及时；（十六）将同业存款纳入一般性存款核算；（十七）同业账户管理不规范；（十八）违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足；（十九）结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；（二十）未严格审查委托贷款资金来源；（二十一）违规向委托贷款借款人收取手续费；（二十二）利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；（二十三）监管检查发现问题屡查屡犯，被中国银行保险监督管理委员会罚款 4100 万元。

2、上银转债

根据 2021 年 11 月 19 日行政处罚决定，上海银行因未按规定报送统计报表，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局罚款 20 万元。

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

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

3、21 招商银行小微债 03

根据 2021 年 5 月 17 日的行政处罚决定，招商银行因：（一）为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；（二）违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；（三）理财产品之间风险隔离不到位；（四）理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；（五）同业投资接受第三方金融机构信用担保；（六）理财资金池化运作；（七）利用理财产品准备金调节收益；（八）高净值客户认定不审慎；（九）并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；（十）投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；（十一）投资集合资金信托计划人数超限；（十二）面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；（十三）信贷资产非真实转让；（十四）全权委托业务不规范；（十五）未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；（十六）通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；（十七）“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩

大业务规模，且业务数据和材料缺失；（十八）票据转贴现假卖断屡查屡犯；（十九）贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；（二十）理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；（二十一）同业投资）理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；（二十二）理财资金认购商业银行增发的股票；（二十三）违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；（二十四）为定制公募基金提供投资顾问；（二十五）为本行承销债券兑付提供资金支持；（二十六）协助发行人以非市场化的价格发行债券；（二十七）瞒报案件信息，被中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元。

对 21 交通银行二级、上银转债以及 21 招商银行小微债 03 的投资决策程序的说明：

本基金管理人认为，上述处罚事项未对上述机构的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的情况，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 40,201.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,268,183.37 |
| 5 | 应收申购款 | 15,831.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,324,216.88 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|---------|-----------|
|----|------|------|---------|-----------|

| | | | | (%) |
|---|--------|------|--------------|------|
| 1 | 113042 | 上银转债 | 9,917,012.80 | 3.95 |
| 2 | 110034 | 九州转债 | 1,199,947.00 | 0.48 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 1,058,590.00 | 0.42 |
| 4 | 127016 | 鲁泰转债 | 558,250.00 | 0.22 |

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 | 250,013,845.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,291,451.50 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 26,252,181.28 |
| 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 | 234,053,115.23 |

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 | 20211001-20211231 | 172, 117, 039. 59 | - | - | 172, 117, 039. 59 | 73. 54% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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、《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》。

- 3、《诺德增强收益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、诺德增强收益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/或基金托管人的办公场所，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

2022 年 1 月 24 日