诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 21 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 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德量化蓝筹	
基金主代码	005082	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 29 日	
报告期末基金份额总额	10,100,631.05 份	
投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	本基金将运用长期资产配置（SAA）和短期资产配置（TAA）相结合的方法，根据市场环境的变化，合理确定基金在股票、债券及货币市场工具等各类资产类别上的投资比例。在长期资产配置保持稳定增值的前提下，积极进行短期资产灵活配置，构建在承受适当风险的前提下可获取较高收益的资产组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	诺德基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
下属分级基金的交易代码	005082	005083
报告期末下属分级基金的份额总额	517,406.00 份	9,583,225.05 份

§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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
1.本期已实现收益	5,968.77	109,036.65
2.本期利润	-17,375.83	-265,937.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0331	-0.0278
4.期末基金资产净值	597,527.32	11,102,909.82
5.期末基金份额净值	1.1549	1.1586

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺德量化蓝筹 A

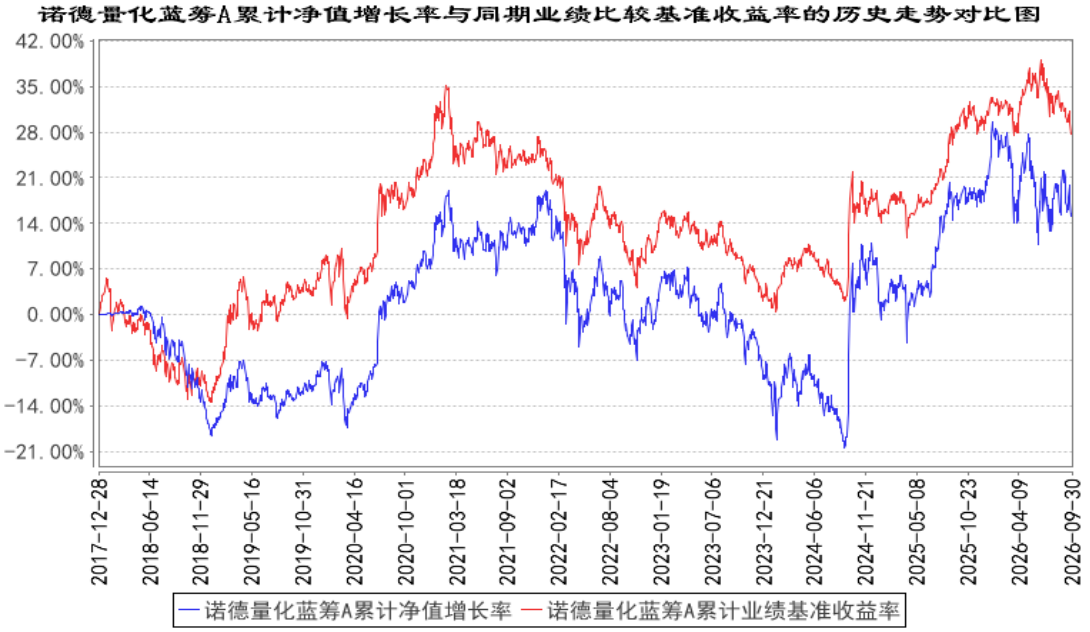
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.32%	1.33%	-7.17%	0.77%	4.85%	0.56%
过去六个月	-0.29%	1.38%	-0.10%	0.77%	-0.19%	0.61%
过去一年	-2.42%	1.20%	-1.93%	0.68%	-0.49%	0.52%
过去三年	17.05%	1.21%	17.65%	0.68%	-0.60%	0.53%
过去五年	2.99%	1.11%	3.57%	0.67%	-0.58%	0.44%
过去七年	33.13%	1.03%	25.03%	0.70%	8.10%	0.33%
自基金合同生效起至今	15.49%	0.97%	27.97%	0.72%	-12.48%	0.25%

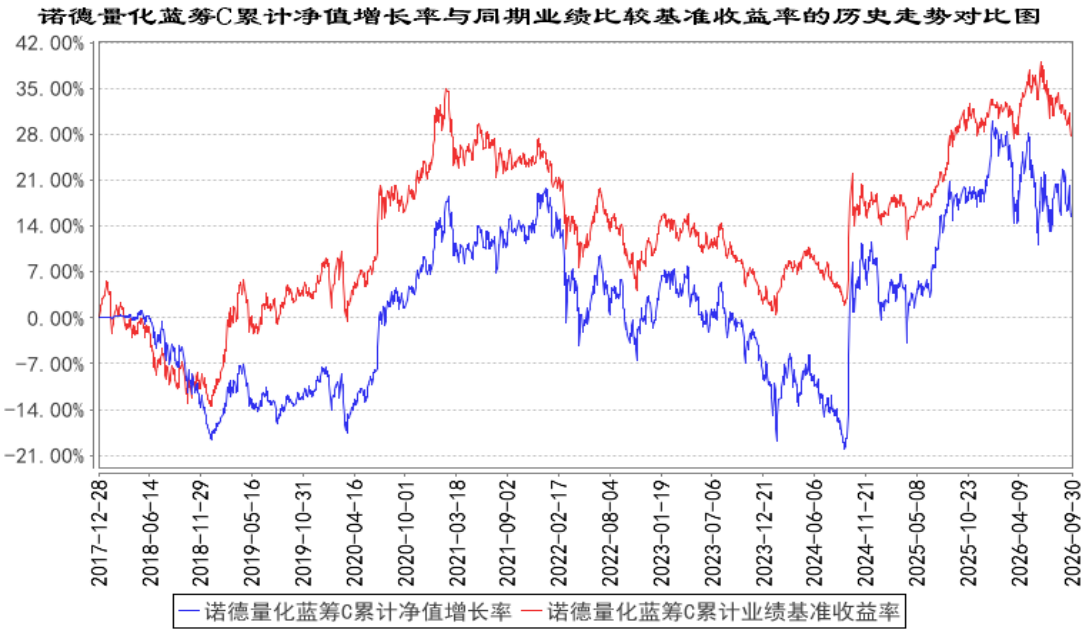
诺德量化蓝筹 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①－③	②－④

		准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-2.33%	1.33%	-7.17%	0.77%	4.84%	0.56%
过去六个月	-0.34%	1.38%	-0.10%	0.77%	-0.24%	0.61%
过去一年	-2.50%	1.20%	-1.93%	0.68%	-0.57%	0.52%
过去三年	16.76%	1.21%	17.65%	0.68%	-0.89%	0.53%
过去五年	2.58%	1.11%	3.57%	0.67%	-0.99%	0.44%
过去七年	33.94%	1.03%	25.03%	0.70%	8.91%	0.33%
自基金合同生效起至今	15.86%	0.97%	27.97%	0.72%	-12.11%	0.25%

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





注：本基金的合同于 2017 年 12 月 29 日生效，图示时间段为 2017 年 12 月 29 日至 2026 年 9 月 30 日。

本基金建仓期间自 2017 年 12 月 29 日至 2018 年 6 月 28 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		
曾文宏	本基金基金经理、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017 年 12 月 29 日	-	14 年	华中师范大学数量经济学硕士。2012 年 6 月至 2014 年 7 月于上海大智慧股份有限公司担任行业研究员兼产品经理，2014 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业部高级研究员，FOF 管理部投资经理等职务，具有基金从业资格。

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

为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的离任日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中使用公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内宏观延续复苏态势，复苏进程逐步推进。国际方面，美联储开启预防式加息，地缘冲突带来的能源价格脉冲对通胀影响较大。

报告期内，股票市场整体震荡调整，但风格层面的极致分化得以阶段性缓解。三季度，本基

金继续采用行业配置策略、个股精选策略，相对业绩比较基准实现小幅超额收益。未来，我们仍将坚持以基本面研究和多因子选股相结合的投资框架，不因短期市场风格的极致演绎而调整长期坚持的投资逻辑。

站在当前时点，我们认为 A 股市场或已得到较为充分的调整，仍存在较大机会。方向上，将继续关注业绩有望迎来拐点或存在超预期可能的公司，同时对业绩存疑的个股保持审慎。风格层面，低位价值板块存在估值修复的空间，而科创板和创业板中具备真成长性的标的也或已进入可布局区间。具体到四季度，我们相对看好能够较好受益于中国经济增长和资本市场发展的券商板块。在坚守价值投资理念的前提下，本基金将力争获取超越业绩比较基准的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 9 月 30 日，诺德量化蓝筹 A 份额净值为 1.1549 元，累计净值为 1.1549 元。本报告期基金份额净值增长率为-2.32%，同期业绩比较基准收益率为-7.17%。诺德量化蓝筹 C 份额净值为 1.1586 元，累计净值为 1.1586 元。本报告期基金份额净值增长率为-2.33%，同期业绩比较基准收益率为-7.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人以及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。自 2024 年 4 月 24 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§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	10,646,947.83	90.89
	其中：股票	10,646,947.83	90.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,051,542.27	8.98

8	其他资产	15,245.60	0.13
9	合计	11,713,735.70	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	22,304.00	0.19
C	制造业	3,484,281.69	29.78
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	59,820.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	430,182.10	3.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,260,588.68	10.77
J	金融业	4,721,829.16	40.36
K	房地产业	185,130.00	1.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	482,812.20	4.13
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	10,646,947.83	91.00

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	000776	广发证券	27,822	553,101.36	4.73
2	601211	国泰海通	32,213	543,433.31	4.64
3	600030	中信证券	20,983	542,620.38	4.64
4	601108	财通证券	65,932	537,345.80	4.59
5	600958	东方证券	61,505	532,018.25	4.55
6	688318	财富趋势	7,068	526,990.08	4.50

7	300033	同花顺	2,475	487,723.50	4.17
8	002967	广电计量	27,495	482,812.20	4.13
9	300059	东方财富	25,622	455,815.38	3.90
10	601198	东兴证券	33,103	432,325.18	3.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，国泰海通（601211）的发行主体国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通”）存在被监管公开处罚的情形。

1、国泰海通（601211）

根据 2026 年 8 月 17 日的行政处罚决定，国泰海通因：未按规定进行国际收支统计直接申报；违反外汇账户管理规定，被国家外汇管理局上海市分局警告，罚款 15 万元。

对国泰海通（601211）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企业的长期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,671.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,573.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,245.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净	流通受限情

			（元）	值比例（%）	况说明
1	601198	东兴证券	432,325.18	3.69	重大事项停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德量化蓝筹 A	诺德量化蓝筹 C
报告期期初基金份额总额	558,260.53	9,563,042.36
报告期期间基金总申购份额	122,683.41	194,058.10
减:报告期期间基金总赎回份额	163,537.94	173,875.41
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	517,406.00	9,583,225.05

注：总申购份额含红利再投资、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	20260701 - 20260930	8,805,515.43	-	-	8,805,515.43	87.18
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。

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、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德量化蓝筹增强混合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、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金本季度报告原文。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人诺德基金管理有限公司，咨询电话 400-888-0009、(021)68604888，或发电子邮件，E-mail:service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日