

# 诺德新生活混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	诺德新生活
场内简称	-
基金主代码	006887
交易代码	006887
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 28 日
报告期末基金份额总额	26,995,575.50 份
投资目标	本基金通过重点投资与新生活主题相关的优质企业，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	本基金采取相对稳健的资产配置策略。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，同时结合不同行业的基本面情况、市场预期变化情况及估值水平，确定合适的资产和行业配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
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	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	诺德新生活 A   诺德新生活 C

下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	006887	006888
报告期末下属分级基金的份额总额	26,995,575.50 份	0.00 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### § 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（2022 年 10 月 1 日 — 2022 年 12 月 31 日）	
	诺德新生活 A	诺德新生活 C
1. 本期已实现收益	-3,802,583.35	-
2. 本期利润	-2,828,275.38	-
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1074	-
4. 期末基金资产净值	24,352,060.60	-
5. 期末基金份额净值	0.9021	0.9021

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

诺德新生活 A

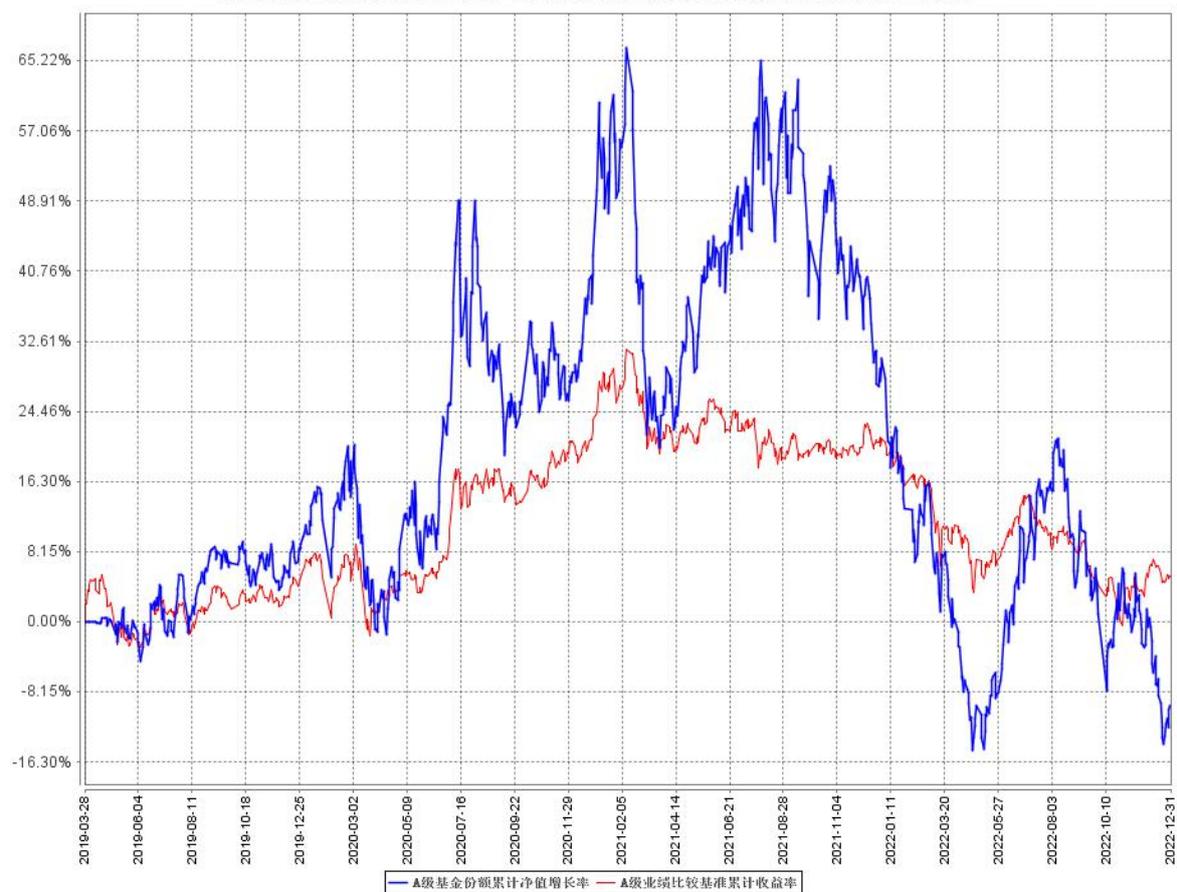
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.58%	2.24%	1.03%	0.76%	-11.61%	1.48%
过去六个月	-15.78%	2.06%	-8.09%	0.66%	-7.69%	1.40%
过去一年	-30.91%	2.01%	-13.11%	0.77%	-17.80%	1.24%
过去三年	-18.23%	2.11%	-0.92%	0.77%	-17.31%	1.34%
自基金合同生效起至今	-9.79%	1.93%	5.35%	0.75%	-15.14%	1.18%

诺德新生活 C

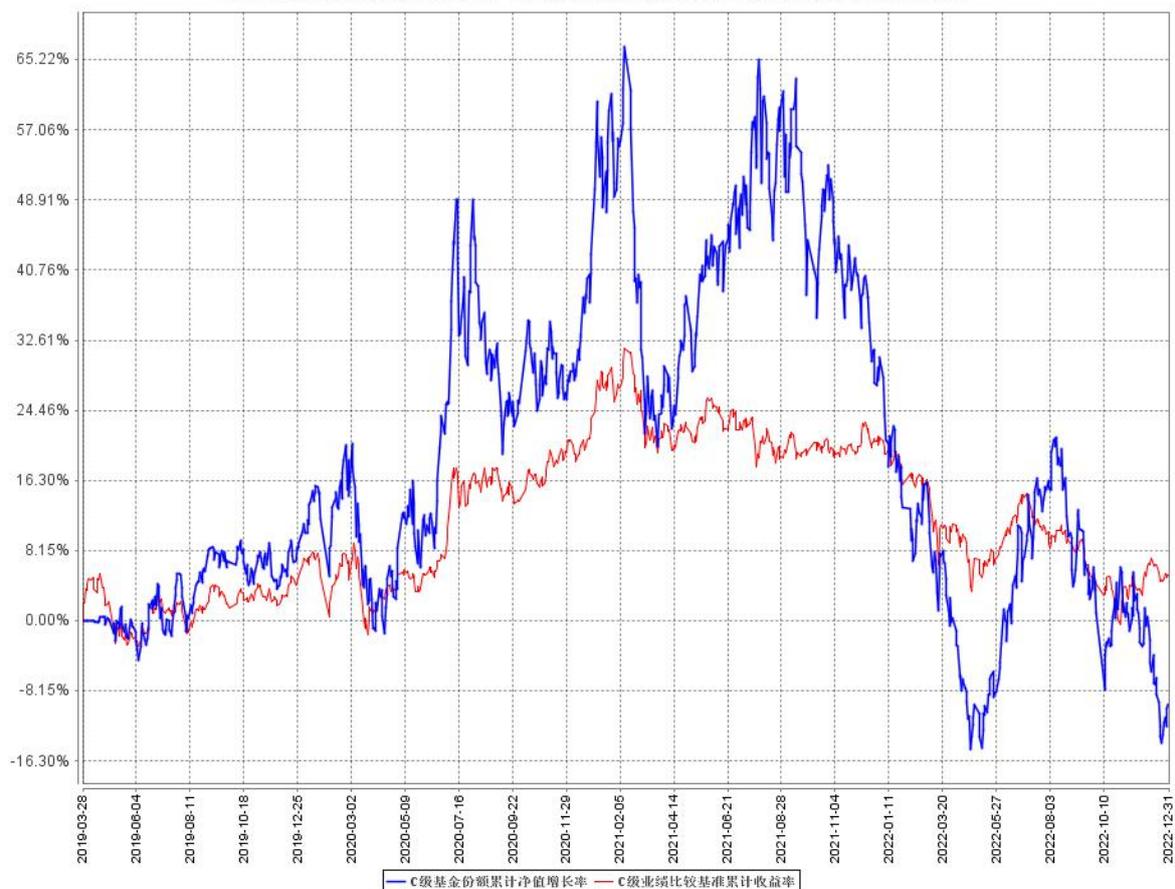
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.58%	2.24%	1.03%	0.76%	-11.61%	1.48%
过去六个月	-15.78%	2.06%	-8.09%	0.66%	-7.69%	1.40%
过去一年	-30.91%	2.01%	-13.11%	0.77%	-17.80%	1.24%
过去三年	-18.23%	2.11%	-0.92%	0.77%	-17.31%	1.34%
自基金合同生效起至今	-9.79%	1.93%	5.35%	0.75%	-15.14%	1.18%

### 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

A级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



C级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 2019 年 3 月 28 日，图示时间段为 2019 年 3 月 28 日至 2022 年 12 月 31 日。

本基金建仓期间自 2019 年 3 月 28 日至 2019 年 9 月 27 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		
潘永昌	本基金基金经理以及诺德中证研发创新	2020 年 3 月 3 日	-	6	上海对外经贸大学金融学硕士。2011 年 9 月至 2013 年 8 月任职于上海汇麟投资有限公司，担任投资研究部数量研究员职务。2016 年 4 月加入诺德基金管理有限

	100 指数型证券投资基金的基金经理				公司，先后担任投资研究部宏观策略研究员、量化投资部量化研究员职务。潘永昌先生具有基金从业资格。
周建胜	本基金基金经理	2022 年 7 月 14 日	-	7	上海交通大学微电子学与固体电子学硕士。历任希姆通信息技术（上海）有限公司软件工程师、华为技术有限公司软件工程师、上海玖石股权投资管理有限公司研究员、上海陆宝投资管理有限公司研究员。2019 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，担任 TMT 行业高级研究员，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

2022 年四季度，申万一级行业中，计算机涨幅 14.18%，传媒涨幅 14.08%，电子涨幅 1.94%，通信涨幅 2.37%，均跑赢了沪深 300 的 1.75% 涨幅。其中，计算机以信创为核心，传媒以受益复苏的院线、影视制作为核心。

报告期内本基金跑输指数，主要是三季度本基金重仓的半导体设备板块，在十月国庆后遭遇了美国新一轮半导体制裁而大幅回撤；本基金重仓的智能汽车龙头，也在市场担忧 2023 年新能源汽车销量的背景下遭遇较大回撤。尽管我们及时调仓到信创板块，但本基金仍承担了部分损失并牺牲了部分潜在受益。信创板块在国庆后开始大涨直到 11 月下旬开始回撤，本着看好信创整体方向和重仓个股基本面的逻辑，我们选择了坚守，为报告期内本基金的净值带来了回撤。

展望 2023 年，我们更加乐观。根据分析当前科技板块估值处于历史相对底部区间，相较其它板块具有吸引力；科技股的机构持仓比例也处于历史低位水平。在 2022 年业绩低基数和产业政策重规划、轻落地的背景下，我们看好 2023 年“十四五”系列规划全面实施的机会，看好“大信创”落地的机会。2023 年我们将紧紧围绕政策主线和产业发展大势来布局，主要观点如下：

1) 政策红利：根据相关政策精神，中国未来将进一步提高重点产业链自主可控能力，为了突破关键核心技术和零部件薄弱环节，新型举国体制落地值得期待。中国需要在核心基础零部件、核心基础元器件、关键基础材料、关键基础软件等科技领域实现诸多突破，相关上市公司责无旁贷。

2) 产业红利：中国在 5G 等新型基础设施建设领域处于领先地位，随着“5G+工业互联网”融合应用逐步深化，许多新兴的细分产业机会也会涌现出来，例如数字矿山、智能汽车、元宇宙等。

3) 数字经济红利：随着土地、人口等传统要素红利的衰退，数字要素越来越成为新的经济增长引擎。预期 2023 年，我国将继续以数字技术创新突破和应用拓展为主攻方向，促进数字经济和

实体经济深度融合。可以期待的方向有：数字基础设施建设、数字产业创新发展（包括集成电路、5G、新型显示、基础软件、核心电子元器件、关键基础材料等）、产业数字化转型（智能工厂、智慧供应链等）。

4) 投资思路：未来我们将围绕“安全”与“发展”两个维度来布局。安全这条线上我们将继续重仓泛信创板块，关注基础软件、信息安全、政务信息化、数字要素等细分板块的机会，同时我们也会积极关注半导体设备、半导体材料与半导体零部件的机会。在发展这条线上，我们一方面会继续关注高景气度持续的机会，例如军工信息化、工业信息化、金融信息化、智能汽车等，另一方面也会关注景气度复苏的机会，关注随着半导体周期拐点和社会生活正常化带来的反转机会。

尽管 2022 年科技板块跑输市场，我们依然相信在“中国百年未有之大变局”的背景下，科技依然是推动中国突破外部封锁、走向中华民族伟大复兴的核心引擎，我们将坚定拥抱科技，拥抱时代赋予我们的历史机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，诺德新生活 A 份额净值为 0.9021 元，累计净值为 0.9021 元。本报告期份额净值增长率为-10.58%，同期业绩比较基准增长率为 1.03%。诺德新生活 C 份额净值为 0.9021 元，累计净值为 0.9021 元。本报告期份额净值增长率为-10.58%，同期业绩比较基准增长率为 1.03%。

#### 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。

## § 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	20,911,036.64	84.44
	其中：股票	20,911,036.64	84.44
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	3,809,395.61	15.38
8	其他资产	44,588.26	0.18
9	合计	24,765,020.51	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	2,153,435.36	8.84
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	18,757,601.28	77.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	20,911,036.64	85.87

### 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	002368	太极股份	63,711	1,792,190.43	7.36
2	688031	星环科技	19,572	1,781,052.00	7.31
3	688111	金山办公	5,937	1,570,277.13	6.45
4	688023	安恒信息	7,867	1,557,666.00	6.40
5	300451	创业慧康	171,233	1,354,453.03	5.56
6	688152	麒麟信安	7,818	1,336,096.20	5.49
7	688232	新点软件	22,491	1,283,336.46	5.27
8	003029	吉大正元	35,700	1,258,782.00	5.17
9	688768	容知日新	11,141	1,258,487.36	5.17
10	600536	中国软件	20,228	1,179,899.24	4.85

#### 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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,012.18
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,576.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	44,588.26

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 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	诺德新生活 A	诺德新生活 C
报告期期初基金份额总额	25,852,910.40	-
报告期期间基金总申购份额	2,519,947.11	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,377,282.01	-
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	26,995,575.50	-

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、《诺德新生活混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德新生活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、诺德新生活混合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

2023 年 1 月 20 日