

## 诺德深证300指数分级证券投资基金

### 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**基金管理人:诺德基金管理有限公司**  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年四月十八日

**5.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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。

本报告中文财务资料未经审计。  
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

5.2.2 被动投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	823,225.68	1.21
B	矿业	2,096,044.74	3.08
C	制造业	29,696,724.74	43.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,075,468.40	1.58
E	建筑业	1,187,103.15	1.74
F	批发和零售业	1,882,007.19	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	351,737.99	0.52
H	住宿和餐饮业	104,469.00	0.15
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,530,887.03	2.23
J	金融业	4,021,268.72	5.90
K	房地产业	4,662,760.74	6.85
L	租赁和商务服务业	20,641.12	0.30
M	科学研究和技术服务业	1,133,361.95	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	348,998.08	0.51
S	综合	247,008.00	0.36
合计		49,369,307.87	72.43

**5.2 基金产品概况**

基金名称:诺德300  
基金代码:162700  
基金运作方式:契约开放式  
基金合同生效日:2012年9月10日  
报告期末基金份额总额:63,987,648.72份

**5.3 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益	2,248,929.50
2.本期利润	-651,678.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0148
4.期末基金份额净值	68.157,207.75
5.期末基金资产净值	1,065,210,912.43

注:1.上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 本基金净值表现

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	①-②	①-②
2013年1月1日至2013年3月31日	1.92%	1.41%	2.76%	-0.46%

3.2.2 自基金合同生效以来本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对比

诺德深证300指数分级证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年9月10日至2013年3月31日)

**3.1 主要财务指标**

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益	2,248,929.50
2.本期利润	-651,678.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0148
4.期末基金份额净值	68.157,207.75
5.期末基金资产净值	1,065,210,912.43

注:1.上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 本基金净值表现

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	①-②	①-②
2013年1月1日至2013年3月31日	1.92%	1.41%	2.76%	-0.46%

3.2.2 自基金合同生效以来本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对比

诺德深证300指数分级证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年9月10日至2013年3月31日)

注:诺德深证300指数分级证券投资基金成立于2012年9月10日,图示时间为2012年9月10日至2013年3月31日。本基金建仓期为2012年9月10日至2013年3月31日,报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

**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日期	证券从业年限	说明
薛峰	本基金基金经理、诺德深证300指数分级证券投资基金基金经理	2012-9-10	6	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。
张英武	本基金基金经理	2012-12-19	4	上海交通大学硕士,2009年加入诺德基金管理有限公司,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。

注:任期间指指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;证券从业的含义遵照证券投资基金法律法规的相关规定。

4.2 管理人报告期内严格遵守法律法规的情况

本报告期,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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,恪尽职守,安全高效的开展管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 异常交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.5 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

**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日期	证券从业年限	说明
薛峰	本基金基金经理、诺德深证300指数分级证券投资基金基金经理	2012-9-10	6	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。
张英武	本基金基金经理	2012-12-19	4	上海交通大学硕士,2009年加入诺德基金管理有限公司,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。

注:任期间指指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;证券从业的含义遵照证券投资基金法律法规的相关规定。

4.2 管理人报告期内严格遵守法律法规的情况

本报告期,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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,恪尽职守,安全高效的开展管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 异常交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.5 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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。

本报告中文财务资料未经审计。  
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称:诺德双翼分级债券型证券投资基金

基金代码:162701

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2012年2月16日

报告期末基金份额总额:263,859,899.99份

**5.3 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益	9,254,077.40
2.本期利润	7,528,595.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0279
4.期末基金份额净值	264,689,762.32
5.期末基金资产净值	1,860,210,912.43

注:1.上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 本基金净值表现

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	①-②	①-②
2013年1月1日至2013年3月31日	2.30%	0.21%	0.44%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来本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对比

诺德双翼分级债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年2月16日至2013年3月31日)

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的股票投资组合

5.3.1 期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排名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	000002	万科A	226,812	2,448,497.12	5.38
2	000631	顺络电子	99,228	1,610,001.68	2.48
3	000001	平安银行	68,929	1,386,851.48	2.03
4	000858	广汇能源	47,026	1,050,560.84	1.54
5	000776	广发证券	69,199	903,046.95	1.32
6	000157	中联重科	111,200	894,048.00	1.31
7	000423	华发股份	14,146	737,066.68	1.08
8	002024	苏宁电器	110,971	706,885.27	1.04
9	000895	汇金股份	8,284	667,347.20	0.98
10	000009	中信证券	7,218	617,139.00	0.91

5.3.2 期末被动投资公允价值占基金资产净值比例大小排名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	000001	平安银行	42,510	4,244,539.20	6.23
2	000008	广汇能源	-	-	-
3	000002	万科A	-	-	-
4	000009	中信证券	-	-	-
5	000157	中联重科	-	-	-
6	000423	华发股份	-	-	-
7	000776	广发证券	-	-	-
8	000858	广汇能源	-	-	-
9	000895	汇金股份	-	-	-
10	000999	招商证券	-	-	-
合计				4,244,539.20	6.23

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

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	120818	12附开8	600,000	60,024,000.00	2.70
2	110802	11附开8	300,000	32,280,000.00	1.45
3	100032	10央行票据32	300,000	29,994,000.00	1.35
4	091908	09国债08	249,510	24,994,728.00	1.12
5	110805	11附开5	200,000	20,974,000.00	0.93

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	091908	09国债08	42,510	4,244,539.20	6.23

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.9 投资股指期货的专项说明

5.9.1 2013年2月22日,宣亚五能源股份有限公司之控股子公司宣亚五能源商务有限责任公司收到四川省委发展和改革委员会(行政发[2013]3号)《行政发[2013]3号》,该决定认为宣亚五能源商务有限责任公司对经销商第三人在市场上低价的最低价格进行干预,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定,并作出罚款一亿二百万元的行政处罚。

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

5.9.3 其他事项说明

**5.4 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日期	证券从业年限	说明
薛峰	本基金基金经理、诺德双翼分级债券型证券投资基金基金经理	2011-11-7	-	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。
薛峰	本基金基金经理、诺德双翼分级债券型证券投资基金基金经理	2011-11-7	-	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。
薛峰	本基金基金经理、诺德双翼分级债券型证券投资基金基金经理	2011-11-7	-	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。

注:任期间指指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;证券从业的含义遵照证券投资基金法律法规的相关规定。

4.2 管理人报告期内严格遵守法律法规的情况

本报告期,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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,恪尽职守,安全高效的开展管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 异常交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.5 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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。

本报告中文财务资料未经审计。  
本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称:诺德双翼分级债券型证券投资基金

基金代码:162701

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2012年2月16日

报告期末基金份额总额:263,859,899.99份

**5.3 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益	9,254,077.40
2.本期利润	7,528,595.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0279
4.期末基金份额净值	264,689,762.32
5.期末基金资产净值	1,860,210,912.43

注:1.上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 本基金净值表现

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	①-②	①-②
2013年1月1日至2013年3月31日	2.30%	0.21%	0.44%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来本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对比

诺德双翼分级债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年2月16日至2013年3月31日)

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的股票投资组合

5.3.1 期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排名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	000002	万科A	226,812	2,448,497.12	5.38
2	000631	顺络电子	99,228	1,610,001.68	2.48
3	000001	平安银行	68,929	1,386,851.48	2.03
4	000858	广汇能源	47,026	1,050,560.84	1.54
5	000776	广发证券	69,199	903,046.95	1.32
6	000157	中联重科	111,200	894,048.00	1.31
7	000423	华发股份	14,146	737,066.68	1.08
8	002024	苏宁电器	110,971	706,885.27	1.04
9	000895	汇金股份	8,284	667,347.20	0.98
10	000009	中信证券	7,218	617,139.00	0.91

5.3.2 期末被动投资公允价值占基金资产净值比例大小排名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	000001	平安银行	42,510	4,244,539.20	6.23
2	000008	广汇能源	-	-	-
3	000002	万科A	-	-	-
4	000009	中信证券	-	-	-
5	000157	中联重科	-	-	-
6	000423	华发股份	-	-	-
7	000776	广发证券	-	-	-
8	000858	广汇能源	-	-	-
9	000895	汇金股份	-	-	-
10	000999	招商证券	-	-	-
合计				4,244,539.20	6.23

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

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	120818	12附开8	600,000	60,024,000.00	2.70
2	110802	11附开8	300,000	32,280,000.00	1.45
3	100032	10央行票据32	300,000	29,994,000.00	1.35
4	091908	09国债08	249,510	24,994,728.00	1.12
5	110805	11附开5	200,000	20,974,000.00	0.93

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	091908	09国债08	42,510	4,244,539.20	6.23

诺德双翼分级债券型证券投资基金成立于2012年2月16日,图示时间为2012年2月16日至2013年3月31日。本基金建仓期为2012年2月16日至2012年8月15日,报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

**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日期	证券从业年限	说明
薛峰	本基金基金经理、诺德双翼分级债券型证券投资基金基金经理	2011-11-7	-	上海财经大学硕士,2007年加入诺德基金管理有限公司,先后在风险控制部和资产管理部从事研究工作,历任风险控制部副经理、资产管理部副经理、基金经理助理、基金经理助理兼基金研究主管职务,具有基金从业资格。

注:任期间指指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;证券从业的含义遵照证券投资基金法律法规的相关规定。

4.2 管理人报告期内严格遵守法律法规的情况

本报告期,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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,恪尽职守,安全高效的开展管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 异常交易专项说明

本公司已建立了投资决策及交易内部控制,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,本基金管理人建立了公平交易制度,确保本基金在买入同一证券时,按照比例执行的原理在各基金间交易执行。报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.5 公平交易专项说明