交银施罗德成长30股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人：交银施罗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：二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银成长30股票	
基金主代码	519727	
交易代码	519727(前端)	519728(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月5日	
报告期末基金份额总额	1,773,532,372.40份	
投资目标	本基金属于成长型股票基金，主要通过投资于不超过30只精选的成长型上市公司股票，在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化以及上市公司成长潜力的基础上，精选业务聚焦型、在所属行业内数一数二的成长型上市公司股票，并通过持有不超过30只股票的集中持股策略，为基金资产谋求长期稳健增值。	
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，以成长型股票为主要投资对象，风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
基金管理人	交银施罗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(2013年7月1日－2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,402,251.48
2.本期利润	32,665,727.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164
4.期末基金资产净值	1,808,035,895.98
5.期末基金份额净值	1.019

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，计入费用后的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

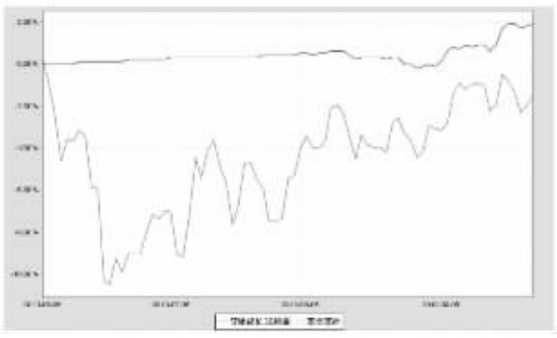
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.70%	0.16%	8.30%	1.02%	－6.60%	－0.86%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

交银施罗德成长30股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年6月5日至2013年9月30日）



注：本基金基金合同生效日为2013年6月5日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2013年9月30日，本基金尚处于建仓期。

§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		
管华雨	本基金的基金经理、交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理、交银施罗德精选股票证券投资基金基金经理、公司权益部总经理	2013-6-5	－	11年	管华雨先生，CFA，博士学历。历任申银万国证券股份有限公司投资部投资经理、高级投资经理，信诚基金管理有限公司分析师、基金经理助理和基金经理。其中2007年5月至2010年5月担任信诚四季红混合型证券投资基金基金经理。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任权益部总经理助理、副总经理。2010年12月22日至2012年3月12日担任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理，2012年3月13日至2013年4月25日担任交银施罗德精选股票证券投资基金基金经理。
王少成	本基金的基金经理、交银施罗德先锋股票证券投资基金基金经理、交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金经理	2013-7-2	－	9年	王少成先生，复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员、中原证券投资经理，信诚基金管理有限公司研究总监助理，东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理，2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司管理的所有投资组合未发生参与的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总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年三季度本基金尚处于建仓期。

三季度本基金保持在较低的仓位。三季度宏观经济虽然起稳，市场预期得到修复，但行情结构性分化的特征依然明显。成长股整体偏贵的局面没有得到实质性的改善。考虑到本基金主要依靠自下而上的选股构建投资组合，所以成立至今一直保持相对较慢建仓节奏。在股票挑选上，更加注重投资品种2014年风险和收益的匹配情况。

四季度内本基金将完成建仓。我们整体上判断四季度流动性的状况可能会偏紧，宏观经济复苏的势头有可能面临受挫局面，行情或将保持震荡格局，高估值板块的相对收益可能会受到一定程度的抑制。基于这样的判断，我们会保持相对稳定的建仓节奏。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日，本基金份额净值为1.019元，本报告期份额净值增长率为1.70%，同期业绩比较基准增长率为8.30%。

§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	447,862,597.33	24.29
	其中：股票	447,862,597.33	24.29
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	金融衍生品投资	－	－
4	买入返售金融资产	692,001,578.00	37.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
5	银行存款和结算备付金合计	702,631,165.55	38.11
6	其他各项资产	991,005.88	0.05
7	合计	1,843,486,346.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	378,975,466.12	20.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	68,887,131.21	3.81
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	－	－
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	447,862,597.33	24.77

5.3 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	300005	探路者	8,486,429	126,872,113.55	7.02
2	000423	东阿阿胶	2,236,448	90,374,863.68	5.00
3	600315	上海家化	1,399,769	60,763,972.29	3.36
4	601117	中国化学	5,847,717	46,313,918.64	2.56
5	600422	昆明制药	1,375,763	37,118,085.74	2.05
6	002140	东华科技	1,145,267	22,573,212.57	1.25
7	600887	伊利股份	446,800	19,963,024.00	1.10
8	000550	江铃汽车	904,896	14,894,588.16	0.82
9	002223	鱼跃医疗	503,855	12,878,533.80	0.71
10	600389	江山股份	247,057	9,815,574.61	0.54

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	66,794.98
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	771,402.70
5	应收申购款	152,808.20
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	991,005.88

5.10.4 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。

5.10.5 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

本报告期期初基金份额总额	2,024,955,437.39
本报告期基金总申购份额	10,635,507.92
减：本报告期基金总赎回份额	262,058,572.91
本报告期基金拆分变动份额	－
本报告期期末基金份额总额	1,773,532,372.40

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等；本基金管理人本报告期末持有本基金份额0.00份，占本基金期末总份额的0.00%。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德成长30股票型证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德成长30股票型证券投资基金之法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德成长30股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com，www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysdd.com。

诺德深证300指数分级证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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：二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德S300		
基金主代码	165707		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年9月10日		
报告期末基金份额总额	65,112,548.70份		
投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对深证300指数的有效跟踪，分享中国经济的持续、稳定增长的成果，实现基金资产的长期增值。		
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制指数的投资方法，按照成份股在深证300指数中的基准权重构建指数化投资组合，以拟合、跟踪深证300指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证300指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	深证300价格指数收益率×95%＋金融同业存款利率×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
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		
下属三级基金的基金简称	诺德300A	诺德300B	诺德S300
下属三级基金的交易代码	150092	150093	165707
报告期末下属三级基金的份额总额	322,995份	322,995份	64,466,558.70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(2013年7月1日－2013年9月30日)
1.本期已实现收益	－75,633.38
2.本期利润	6,690,913.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.1359
4.期末基金资产净值	72,184,609.68
5.期末基金份额净值	1.109

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

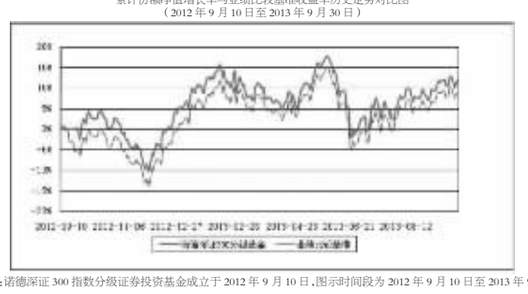
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2013年7月1日至2013年9月30日	12.36%	1.30%	12.91%	1.31%	－0.55%	－0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

诺德深证300指数分级证券投资基金

累计份额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9月30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，图示时间段为2012年9月10日至2013年9月30日。

本基金建仓期为2012年9月10日至2013年3月9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		
薛珠	本基金基金经理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理	2012-9-10	－	6	上海财经大学硕士，2007年3月加入诺德基金管理有限公司，先后在风险控制部和投资研究部从事投资研究相关工作，历任助理研究员、研究员、高级研究员、基金经理助理兼数量研究主管职务，具有基金从业资格。
张敬燕	本基金基金经理	2012-12-19	－	4	上海交通大学理学硕士，2009年4月起任职于诺德基金管理有限公司，曾先后担任风险控制部助理研究员、量化投资策略研究员、风险管理与量化策略部量化投资策略研究员兼风险控制主管，具有基金从业资格。

注：任职日期是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；证券从业的含义遵守行业协会《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》、《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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我们根据自行开发的指数基金管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理等事件，使得本基金的年化波动率控制在与业绩基准基本相当的水平。

报告期内本基金遵循被动化指数投资策略，努力控制净值表现与业绩基准的偏差，从实际效果来看报告期内本基金与业绩基准收益的偏差主要来源于申购赎回和三位小数净值计算带来的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年09月30日，本基金份额净值为1.109元，累计净值为1.118元。本报告期份额净值增长率为12.36%，同期业绩比较基准增长率为12.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标，期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

§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	62,370,749.97	80.91
	其中：股票	62,370,749.97	80.91
2	固定收益投资	2,290,659.20	2.97
	其中：债券	2,290,659.20	2.97
	资产支持证券	－	－
3	金融衍生品投资	－	－
4	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
5	银行存款和结算备付金合计	4,810,554.30	6.24
6	其他各项资产	7,617,776.78	9.88
7	合计	77,089,740.25	100.00

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,140,027.07	1.58
B	采矿业	1,545,625.58	2.14
C	制造业	35,848,359.89	49.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	818,285.96	1.13
E	建筑业	1,831,963.30	2.54
F	批发和零售业	3,602,037.27	4.99
G	交通运输、仓储和邮政业	465,115.47	0.64
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,497,015.52	3.46
J	金融业	4,484,934.13	6.21
K	房地产业	5,417,052.43	7.50
L	租赁和商务服务业	952,477.90	1.32
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	1,724,585.00	2.39
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	1,920,665.45	2.66
S	综合	122,605.00	0.17
	合计	62,370,749.97	86.40

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 期末指数投资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	000002	万科A	276,955	2,528,599.15	3.50
2	000651	格力电器	68,588	1,821,697.28	2.52
3	002024	苏宁云商	131,151	1,685,290.35	2.33
4	000001	平安银行	127,596	1,515,840.48	2.10
5	300027	华谊兄弟	16,660	1,297,480.80	1.80
6	000858	五粮液	65,967	1,187,406.00	1.65
7	000776	广发证券	99,811	1,182,760.35	1.64
8	000538	云南白药	9,318	1,090,765.08	1.51
9	002415	海康威视	38,524	1,017,033.60	1.41
10	002241	歌尔声学	23,181	980,092.68	1.36

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	2,290,659.20	3.17
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	－	－
8	其他	－	－
9	合计	2,290,659.20	3.17

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	019307	13国债07	12,880	1,289,159.20	1.79
2	019302	13国债02	10,000	1,001,500.00	1.39

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本基金投资国债期货的投资政策

本基金投资范围不包括国债期货。

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持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金投资范围不包括国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 2013年2月22日，宜宾五粮液股份有限公司之控股子公司宜宾五粮液酒类销售有限责任公司收到四川省发展和改革委员会《行政处罚决定书》（川发改价检处[2013]1号），该决定书认为宜宾五粮液酒类销售有限责任公司对经销商向第三人销售五粮液白酒的最低价格进行限定，违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定，并作出罚款二亿零二百万元的行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明：本基金是纯被动指数基金，对五粮液维持了标准配置比例。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	64,287.82
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	36,879.00
5	应收申购款	7,516,609.96
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	7,617,776.78

5.10.4 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转股期可转债。

5.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德300A	诺德300B	诺德S300
本报告期期初基金份额总额	532,689.00	532,689.00	51,917,257.28
本报告期基金总申购份额	－	－	60,118,997.28
减：本报告期基金总赎回份额	－	－	47,989,083.86
本报告期基金拆分变动份额	－209,694.00	－209,694.00	419,388.00
本报告期期末基金份额总额	322,995.00	322,995.00	64,466,558.70

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算调整份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

诺德基金管理有限公司本季度未申购或赎回本基金。

§8 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、中国证监会关于同意诺德深证300指数分级证券投资基金募集的批复。

2、《诺德深证300指数分级证券投资基金基金合同》。

3、《诺德深证300指数分级证券投资基金招募说明书》。

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、诺德深证300指数分级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，或发电子邮件，E-mail:service@lordabbettchina.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一三年十月二十四日

诺德双翼分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德双翼分级债券(诺德双翼)	
基金主代码	165705	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2012年2月16日	
报告期末基金份额总额	228,051,467.15份	
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	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。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，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	华夏银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	双翼A	双翼B
下属两级基金的交易代码	165706	150068
报告期末下属两级基金的份额总额	93,475,660.74份	134,575,806.41份
下属两级基金的风险收益特征	本基金成立后的3年内，本基金经过基金份额分级后，双翼A为低风险、预期收益相对稳定的基金份额。	本基金成立后的3年内，本基金经过基金份额分级后，双翼B为较高风险、预期收益较高的基金份额。

§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(2013年7月1日－2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,930,760.90
2.本期利润	－1,805,388.56
3.加权平均基金份额本期利润	－0.0073
4.期末基金资产净值	248,835,765.38
5.期末基金份额净值	1.091

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

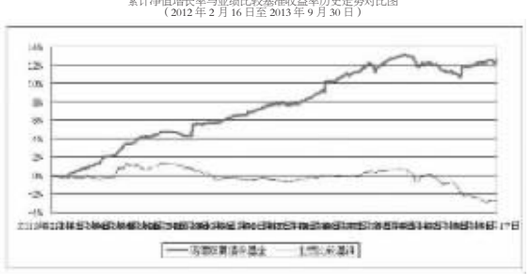
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2013年7月1日至2013年9月30日	0.47%	0.17%	－2.68%	0.10%	3.15%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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9月30日）



注：诺德双翼分级债券型证券投资基金成立于2012年2月16日，图示时间段为2012年2月16日至2013年9月30日。

本基金建