

(上接B11版)
十四、基金的投资组合报告
本基金组合报告内容节选自《诺德双翼分级债券证券投资基金季度报告(2014年第2季度)》，报告截至日期为2014年6月30日。

报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额	
1	权益投资	-	
其中：股票	-	-	
2	固定收益投资	423,696,076.44	
其中：债券	423,696,076.44	92.87%	
货币市场基金	-	-	
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资	-	
5	买入返售金融资产	2,000,000.00	
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.44%	
6	银行存款和结算备付金合计	13,323,271.14	2.92%
7	其他各项资产	17,204,683.48	3.77%
8	合计	456,224,031.06	100.00%

2. 报告期末涉及行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

4. 报告期末按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	国债	37,948,178.00	17.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
其中：政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	385,747,898.44	181.16
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	423,696,076.44	198.98

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十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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十名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 其他资产

9. 合计

10. 报告期末按行业分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

11. 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。

12. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

13. 其他资产

14. 合计

15. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

16. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

17. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

18. 其他资产

19. 合计

20. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

21. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

22. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

23. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

24. 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。

25. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

26. 其他资产

27. 合计

28. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

29. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

30. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

31. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

32. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

33. 其他资产

34. 合计

35. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

36. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

37. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

38. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

39. 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。

40. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

41. 其他资产

42. 合计

43. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

44. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

45. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

46. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

47. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

48. 其他资产

49. 合计

50. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

51. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

52. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

53. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

54. 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。

55. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

56. 其他资产

57. 合计

58. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

59. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

60. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

61. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

62. 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。

63. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

64. 其他资产

65. 合计

66. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

67. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

68. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

69. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

70. 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。

71. 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黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

72. 其他资产

73. 合计

74. 报告期末按行业分类的黄金白银投资组合

本基金本报告期末未持有黄金白银。

75. 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

76. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

77. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

78. 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

</div