



# 信息披露

2014年9月27日 星期六  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B12

(上接B11版)

| 四、基金的投资组合报告   |                  |                |              |
|---|------------------|----------------|--------------|
| 本报告组合内容节选自诺德双翼分级债券型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。 |                  |                |              |
| 1. 报告期末基金资产组合情况   |                  |                |              |
| 序号  | 项目               | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
| 1   | 权益投资             | --             | --           |
| 2   | 其中:股票            | --             | --           |
| 3   | 固定收益投资           | 423,696,076.44 | 92.87        |
| 4   | 其中:债券            | 423,696,076.44 | 92.87        |
| 5   | 资产支持证券           | --             | --           |
| 6   | 贵金属投资            | --             | --           |
| 7   | 金融衍生品投资          | --             | --           |
| 8   | 买入返售金融资产         | 2,000,000.00   | 0.44         |
| 9   | 其中:买入返售的买入返售金融资产 | --             | --           |
| 10  | 银行存款和结算备付金合计     | 13,323,271.14  | 2.92         |
| 11  | 其他各项资产           | 17,204,683.48  | 3.77         |
| 12  | 合计               | 456,224,031.06 | 100.00       |
| 2. 报告期末按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. 报告期末按券种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  | 国债债券      | 37,948,176.00  | 17.82        |
| 2  | 央行票据      | --             | --           |
| 3  | 金融债       | --             | --           |
| 4  | 其中:政策性金融债 | --             | --           |
| 5  | 企业债       | 385,747,898.44 | 181.16       |
| 6  | 中期票据      | --             | --           |
| 7  | 短期融资券     | --             | --           |
| 8  | 可转债       | --             | --           |
| 9  | 其他        | --             | --           |
| 10 | 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序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                                       | 126019 | 08荣长债   | 170,760 | 16,295,626.80 | 7.65         |
| 2                                       | 010107 | 21国债(7) | 150,000 | 15,120,000.00 | 7.10         |
| 3                                       | 018001 | 国开1301  | 137,360 | 14,051,928.00 | 6.60         |
| 4                                       | 122117 | 11南高速   | 120,000 | 12,144,000.00 | 5.70         |
| 5                                       | 122921 | 10国债(1) | 117,100 | 12,143,270.00 | 5.70         |
| 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。                      |        |         |         |               |              |
| 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。                         |        |         |         |               |              |

(上接B10版)

| 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  | 601088 | 中国神华 | 400,000   | 5,816,000.00 | 8.50         |
| 2  | 600288 | 中国石化 | 1,087,500 | 5,731,125.00 | 8.37         |
| 3  | 601699 | 潞安环能 | 343,600   | 2,607,524.00 | 3.81         |
| 4  | 600121 | 三联泵业 | 320,000   | 2,406,400.00 | 3.52         |
| 5  | 000937 | 冀中能源 | 410,000   | 2,390,300.00 | 3.49         |
| 6  | 600549 | 广汇矿业 | 93,232    | 2,370,404.20 | 3.46         |
| 7  | 601898 | 中国能源 | 500,860   | 2,018,465.80 | 2.95         |
| 8  | 601857 | 中国石化 | 260,000   | 1,960,400.00 | 2.86         |
| 9  | 002155 | 辰光矿业 | 254,400   | 1,902,912.00 | 2.78         |
| 10   | 600348 | 辰光矿业 | 335,000   | 1,889,400.00 | 2.76         |
| 4. 报告期末按券种品种分类的债券投资组合  |        |      |           |              |              |
| 本基金本报告期末未持有债券投资。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。   |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。  |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  |        |      |           |              |              |
| (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资股指期货的投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明   |        |      |           |              |              |
| (1) 本期国债期货投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (3) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| 11. 股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| (1) 2014年4月13日中国石化发布公告,国务院对山东省青岛市“11·22”中石化黄潍输油管线泄漏爆炸特别重大事故调查组已出具调查报告,同意国务院事故调查组的调查结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币175.172亿元,公司将承担其相应赔偿责任。 |        |      |           |              |              |
| 本基金管理人通过上述上市公司进行进一步分析和研判,认为该发现不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人将对上述股票的投资判断未发生变更。  |        |      |           |              |              |
| 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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。   |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资的前十名证券未超出基金合同约定的备选股票库。  |        |      |           |              |              |
| (3) 其他资产构成   |        |      |           |              |              |

| 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  | 601088 | 中国神华 | 400,000   | 5,816,000.00 | 8.50         |
| 2  | 600288 | 中国石化 | 1,087,500 | 5,731,125.00 | 8.37         |
| 3  | 601699 | 潞安环能 | 343,600   | 2,607,524.00 | 3.81         |
| 4  | 600121 | 三联泵业 | 320,000   | 2,406,400.00 | 3.52         |
| 5  | 000937 | 冀中能源 | 410,000   | 2,390,300.00 | 3.49         |
| 6  | 600549 | 广汇矿业 | 93,232    | 2,370,404.20 | 3.46         |
| 7  | 601898 | 中国能源 | 500,860   | 2,018,465.80 | 2.95         |
| 8  | 601857 | 中国石化 | 260,000   | 1,960,400.00 | 2.86         |
| 9  | 002155 | 辰光矿业 | 254,400   | 1,902,912.00 | 2.78         |
| 10   | 600348 | 辰光矿业 | 335,000   | 1,889,400.00 | 2.76         |
| 4. 报告期末按券种品种分类的债券投资组合  |        |      |           |              |              |
| 本基金本报告期末未持有债券投资。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。   |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。  |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  |        |      |           |              |              |
| (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资股指期货的投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明   |        |      |           |              |              |
| (1) 本期国债期货投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (3) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| 11. 股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| (1) 2014年4月13日中国石化发布公告,国务院对山东省青岛市“11·22”中石化黄潍输油管线泄漏爆炸特别重大事故调查组已出具调查报告,同意国务院事故调查组的调查结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币175.172亿元,公司将承担其相应赔偿责任。 |        |      |           |              |              |
| 本基金管理人通过上述上市公司进行进一步分析和研判,认为该发现不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人将对上述股票的投资判断未发生变更。  |        |      |           |              |              |
| 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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。   |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资的前十名证券未超出基金合同约定的备选股票库。  |        |      |           |              |              |
| (3) 其他资产构成   |        |      |           |              |              |

| 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  | 601088 | 中国神华 | 400,000   | 5,816,000.00 | 8.50         |
| 2  | 600288 | 中国石化 | 1,087,500 | 5,731,125.00 | 8.37         |
| 3  | 601699 | 潞安环能 | 343,600   | 2,607,524.00 | 3.81         |
| 4  | 600121 | 三联泵业 | 320,000   | 2,406,400.00 | 3.52         |
| 5  | 000937 | 冀中能源 | 410,000   | 2,390,300.00 | 3.49         |
| 6  | 600549 | 广汇矿业 | 93,232    | 2,370,404.20 | 3.46         |
| 7  | 601898 | 中国能源 | 500,860   | 2,018,465.80 | 2.95         |
| 8  | 601857 | 中国石化 | 260,000   | 1,960,400.00 | 2.86         |
| 9  | 002155 | 辰光矿业 | 254,400   | 1,902,912.00 | 2.78         |
| 10   | 600348 | 辰光矿业 | 335,000   | 1,889,400.00 | 2.76         |
| 4. 报告期末按券种品种分类的债券投资组合  |        |      |           |              |              |
| 本基金本报告期末未持有债券投资。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。   |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 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投资。  |        |      |           |              |              |
| 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。   |        |      |           |              |              |
| 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  |        |      |           |              |              |
| (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资股指期货的投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资股指期货。  |        |      |           |              |              |
| 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明   |        |      |           |              |              |
| (1) 本期国债期货投资政策   |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (2) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| (3) 本期国债期货投资的投资策略  |        |      |           |              |              |
| 本基金未投资国债期货。  |        |      |           |              |              |
| 11. 股指期货持仓和损益明细  |        |      |           |              |              |
| (1) 2014年4月13日中国石化发布公告,国务院对山东省青岛市“11·22”中石化黄潍输油管线泄漏爆炸特别重大事故调查组已出具调查报告,同意国务院事故调查组的调查结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币175.172亿元,公司将承担其相应赔偿责任。 |        |      |           |              |              |
| 本基金管理人通过上述上市公司进行进一步分析和研判,认为该发现不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人将对上述股票的投资判断未发生变更。  |        |      |           |              |              |
| 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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。   |        |      |           |              |              |
| (2) 本基金投资的前十名证券未超出基金合同约定的备选股票库。  |        |      |           |              |              |
| (3) 其他资产构成   |        |      |           |              |              |

|  |
|--|
| 11. 关联方投资  |
| (1) 2014 年 4 月 13 日中国证监会公告：国务院对山东省鲁南“11·22”中石化黄岛输油管道爆炸特别重大事故调查报告作出批复指出，国务院事故调查组的调查处理结果，对中国石化及其控股的 48 家企业予以经济处罚，并涉嫌犯罪的 15 名企业相关人员移送司法机关依法追究刑事责任。根据国务院事故调查组的处罚决定，本次事故造成经济损失折合人民币 75.172 万元，公司承担相应比例赔偿责任。 |
| 本基金管理人通过上述上市公司公告进一步了解和分析，认为该处罚不会对公司的投资价值 and 真实性造成影响，因此本基金管理人对于上述股票的投资判断未发生改变。   |
| 报告期内，本基金投资的前十名证券中的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或公告违法违规期限内未受到公开谴责、处罚的情况。   |
| (2) 本基金投资的前十名股票未出现基金合同规定的备选股票。   |