

诺德增强收益债券型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人:诺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:二〇一二年四月二十三日
重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的完整性、准确性和真实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基金合同规定,已于2012年4月20日复核了本基金中的财务指标、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。

本基金合同财务数据未经审计。

本基金报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 诺德增强收益债券

基金主代码 573003

交易代码 573003

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2009年3月4日

报告期末基金份额总额 53,841,549.60份

本基金为定期开放式管理的债券型基金,主要通过全面投资于各类债券品种,在获得稳定的利息收入的基础上,争取获得更多的资本利得收益。本基金的持续经营能力依赖于基金管理人的主动管理。

本基金所处的行业分析见附录四“国内外宏观经济形势分析”、“政策的环境和市场情况”和“市场价格走势分析”。

本基金通过分析国内外宏观经济形势,政府的政策和市场的变化,对各种债券品种的风险溢价进行评估,并在此基础上通过各种债券品种进行相对价值分析,结合考虑收益、流动性、信用风险和利率变化等要素,主动地调整和监控投资组合,获得最佳的回报。

本基金将直接投资于货币市场基金、短期融资券、企业债、公司债、可转换债券、国债、金融债、央行票据、回购协议、资产支持证券、权证、股票、债券基金、货币基金、债券型基金、混合型基金、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 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(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 279,057.87

2.本期利润 815,299.89

3.加权平均基金份额本期利润 0.0154

4.期末基金份额净值 52,691,587.63

5.期末基金份额总额 0.979

注: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。

6.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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 本基金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 净值增长净率① 净值增长标准差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

2012年1月1日至2012年3月31日 1.66% 0.18% 0.29% 0.16% 1.37% 0.02%

注:本基金累计份额净值增长率变动能及与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动能及与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 诺德增强收益债券型证券投资基金 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图(2009年3月1日至2012年3月31日)

注:诺德增强收益债券型证券投资基金成立于2009年3月4日,图示时间段为2009年3月4日至2012年3月31日。

3.2.4 本基金建仓期为2009年3月4日至2009年9月3日。报告期结束资产配置比例符合本基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

赵滔滔 基金经理,理财、语录、财经类基金、股票型基金基金经理 2010-6-23 - 5 上海财经大学金融学专业,2006年11月至2008年10月,任上海中海投资有限公司项目经理;2008年10月,任上海中海投资有限公司项目经理;2008年10月,加入诺德基金管理有限公司,担任基金经理助理,固定收益研究员等职务。赵滔滔先生现为诺德增强收益债券型基金的基金经理兼诺德基金管理有限公司董事。

张辉 基金经理 2010-6-23 - 15 美国纽约大学(New York University)工商管理硕士(MBA),1994年1月起任摩根大通(JP Morgan)高级经理,美国通用电气(GE)高级经理,2008年9月加入诺德基金管理有限公司,先后担任基金经理助理等职务,现任本基金基金经理。张辉先生具有基金从业资格和证券投资基金管理经验,具备良好的职业操守。

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程序后向外公布的任职日期;证券从业的定义遵照行业协会《从业人员执业行为准则》的规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守基金法、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规及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前提下,为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 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,通过系统平台和人工操作相结合的方式,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。

4.3.2 交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,通过系统平台和人工操作相结合的方式,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。

4.4 公平交易制度的执行情况

本基金严格按照《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见》,通过系统平台和人工操作相结合的方式,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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望