

诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)

[2015] 第二季度报告

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

报告送出日期：二〇一五年七月十八日

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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、完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和基金托管人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，并对定期报告中财务数据的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

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财产，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。

报告期间中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称	诺德双翼债券
场内简称	诺德双翼
基金主代码	166706
交易代码	166706
基金运作方式	契约型、上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2012年1月6日
报告期末基金份额总额	178,043.1027万份
投资目标	本基金追求基金资产稳健的基础上，力求获得高于业绩比较基准的收益。
风险收益特征	本基金通过研究分析内外宏观经济形势、政府的货币政策和市场资金供求状况，结合对各种金融品种进行价值分析，综合考虑收益性、流动性、信用风险和操作便利化程度等因素，主动地调整组合投资仓位，从长线控制投资风险，长期稳健地获得债券投资的个券。
投资策略	本基金将通过深入研究分析宏观经济形势、政府的货币政策和市场资金供求状况，通过评估不同金融品种的预期收益率、风险、信用风险和操作便利化程度等，选择风险相对较低、预期收益率较高的金融品种，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资的个券的目的。
业绩比较基准	中国国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中低风险的基金品种，其风险收益预期低于货币市场基金、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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标				
报告期				单位：人民币元
1.本期已实现收益				8,612,146.08
2.期初利润				-1,775,714.06
3.归属于基金份额持有人的本期利润				-0.0006
4.期末基金资产净值				178,321,944.61
5.期末基金份额净值				0.9988

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，本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.基金的表决权。

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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.48% 1.24% 0.14% -2.02% 1.10%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年1月6日至2015年6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2015年6月30日。本基金建仓期间自2012年2月16日至2012年8月15日，报告期内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

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		
赵滔滔	本基金基金经理 基金经理助理 本基金基金经理 基金经理助理	2012-02-16	-	8	上海财经大学金融硕士，2006年7月获硕士学位。2006年7月至2008年10月就职于诺德基金管理有限公司，担任研究员；2008年10月加入诺德基金管理有限公司，担任研究员，现任基金经理。具有基金从业资格。

任职日期即为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中国证监会《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情况的说明

4.2.1 本报告期内，本基金严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及基金合同的有关规定，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，在认真控制和防范风险的基础上，为基金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。

4.2.2 平衡交易的专项说明

4.2.3 平衡交易制度的执行情况

4.2.4 对异常交易行为的专项说明

4.2.5 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.6 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.7 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.8 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.9 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.10 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.11 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.12 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.13 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.14 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.15 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.16 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.17 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.18 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.19 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.20 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.21 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.22 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.23 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.24 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.25 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.26 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.27 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.28 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.29 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.30 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.31 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.32 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.33 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.34 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.35 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.36 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.37 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.38 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.39 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.40 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.41 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.42 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.43 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.44 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.45 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.46 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.47 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.48 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.49 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.50 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.51 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.52 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.53 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.54 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.55 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.56 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.57 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.58 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.59 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.60 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.61 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.62 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.63 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.64 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.65 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.66 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.67 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.68 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.69 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.70 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.71 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.72 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.73 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.74 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.75 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.76 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.77 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.78 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.79 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.80 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.81 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.82 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.83 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.84 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.85 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.86 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.87 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.88 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.89 对涉及挪用资金、利益输送、不公平对待不同客户、不公平交易行为的专项说明

4.2.90 对涉及内幕交易行为的专项说明

4.2.91 对涉及不公平交易行为的专项说明

4.2.92 对涉及操纵市场行为的专项说明

4.2.93 对涉及利用未公开信息交易行为的专项说明

4.2.94 对涉及挪用资金、利益