诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）

【2015】第三季度报告

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：二〇一五年十月二十七日

§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2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德双翼债券
场内简称	诺德双翼
基金主代码	165705
交易代码	165705
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2月16日
报告期末基金份额总额	163,079,094.86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

§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（2015年7月1日-2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-15,549,553.24
2.本期利润	-5,763,181.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0348
4.期末基金资产净值	158,191,412.94
5.期末基金份额净值	0.970

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

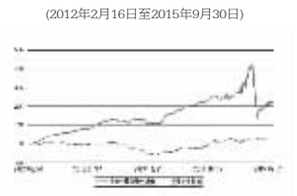
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.81%	0.63%	1.31%	0.08%	-4.12%	0.55%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

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历史走势对比图

(2012年2月16日至2015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2015年9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		
赵滔滔	本基金基金经理、诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理	2012-02-16	-	8	上海财经大学金融学硕士，2006年11月至2008年10月，任职于平安资产管理有限责任公司。2008年10月加入诺德基金管理有限公司，担任债券交易员，固定收益研究员等职务，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》、《公开募集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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年3季度债券市场继续小幅上涨，主要是股灾发生后银行理财资金的资产配置方向从股市配资、打新等市场撤出进入债券市场，从而推动债券市场供求关系发生变化导致债券市场上涨。另外，3季度央行再次降息降准，资金利率进一步降低，打开了债券息差投资策略的空间，进一步加大了债券的需求推动市场上涨。转债市场受到股票市场下跌影响本季度表现不佳。

第三季度本基金采用积极的资产配置策略，一方面增加中、短久期，资质较好的信用品种的配置比例，提高组合资产的杠杆率，另外配置了部分长久期国债来保持组合的进攻性；另一方面，对转债资产进行波段操作，希望能够增厚组合收益。总体来看，纯债组合久期较短、票息较高，收益情况较稳定；但是，转债资产在市场不断下跌的情况下损失较大。报告期内本基金跑输业绩比较基准主要是因为超配了可转债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金份额净值为0.970元，累计净值为1.196 元。本报告期份额净值增长率为-2.81%，同期业绩比较基准增长率为1.31%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年第4季度，经济下行的压力仍较大，宽松的货币政策将延续，未来降息、降准仍有空间。对于债市来说，下行的经济基本面和宽松的货币环境对债市影响仍然正面，但是需关注股市回暖导致投资者风险偏好上行给债券市场带来的冲击。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	222,826,831.60	86.95
	其中：债券	222,826,831.60	86.95
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,225,579.24	2.43
7	其他各项资产	27,228,879.17	10.62
8	合计	256,281,290.01	100.00

5.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	12,893,305.00	8.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,072,800.00	5.10
	其中：政策性金融债	8,072,800.00	5.10
4	企业债券	201,860,726.60	127.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	222,826,831.60	140.86

5.5 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	112069	12明牌债	110,000.00	11,459,800.00	7.24
2	1380320	13龙岩汇金债	100,000.00	10,749,000.00	6.79
3	112045	11宗申债	100,000.00	10,692,000.00	6.76
4	122132	12鹏博债	100,000.00	10,519,000.00	6.65
5	112062	12新都债	100,000.00	10,490,000.00	6.63

5.6 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。

5.7 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

本基金未投资贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	130,288.66
2	应收证券清算款	19,300,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,782,563.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	16,027.10
8	其他	-
9	合计	27,228,879.17

5.11.4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债。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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	178,643,102.77
本报告期基金总申购份额	1,133,893.94
减：本报告期基金总赎回份额	16,697,901.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	163,079,094.86

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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双翼分级债券型证券投资基金募集的批复。

2、《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德双翼分级债券型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、诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)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/或基金托管人的办公场所，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@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日

诺德优选30混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人：诺德基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

§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2015年10月26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。

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及各相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，自2015年8月8日起“诺德优选30股票型证券投资基金”变更为“诺德优选30混合型证券投资基金”，并相应修订基金合同部分条款。此次变更基金名称并修订基金合同的事项对基金份额持有人的利益无重大实质影响，亦不涉及基金合同当事人的重大权利义务变化，依据法律法规和基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。详见诺德基金管理有限公司2015年8月8日披露的《关于诺德基金管理有限公司旗下股票型基金变更基金类别并修订基金合同的公告》。

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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德优选30混合
基金主代码	570007
交易代码	570007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月5日
报告期末基金份额总额	78,013,966.37份
投资目标	本基金重点关注具备高成长潜力的行业和个股，在严格控制风险的前提下，通过集中投资于具备充分成长空间的和持续竞争优势的优质企业，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金秉承长期投资和价值投资的理念，在过度分散和过度集中之间寻求一种平衡，精选股票构建投资组合，在对宏观经济、行业和企业基本面进行深入研究的基础上，挖掘成长性良好且经营稳健的企业，进行积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	3%*深300指数×80%+同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§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（2015年7月1日-2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-19,879,457.29
2.本期利润	-45,308,776.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5362
4.期末基金资产净值	93,044,186.03
5.期末基金份额净值	1.193

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

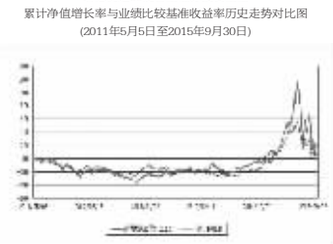
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-29.03%	4.67%	-22.96%	2.67%	-6.07%	2.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

诺德优选30混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年5月5日至2015年9月30日)



注：诺德优选30混合型证券投资基金成立于2011年5月5日，图示时间段为2011年5月5日至2015年9月30日。本基金建仓期为2011年5月5日至2011年11月4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		
李圣春	本基金基金经理	2013-05-28	-	8	第二军医大学医学硕士，2009年12月加入诺德基金管理有限公司研究部，先后担任了医药行业研究员、基金经理助理、基金经理等职务，曾先后任职于上海市中药研究所、上海药谷药业有限公司、上海用正医药科技有限公司、上海塔品投资管理有限公司，具有基金从业资格，现任诺德优选30混合型证券投资基金基金经理。

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》、《公开募集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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年3季度，经济数据仍然下滑，稳增长压力加大、改革阻力也加大，市场对经济预期悲观，随着对场外配资监管力度的加大，风险偏好明显下降，以杠杆牛为特征的市场出现了快速下跌，所有指数几乎回吐了上半年的全部涨幅。

报告期内本基金秉承“持续成长性”投资风格，坚持“精选个股”策略。重点配置了公用事业、医药、农林牧渔、通信、商业零售、电子、休闲服务、计算机等行业。持仓主要集中在业绩成长确定、估值相对较低个股上。本基金“持续成长”和精选个股的投资风格，在3季度整体下跌的过程中，虽然保住了年初以来的一部分绝对收益，但由于期间整体仓位处于中性较高水平，致使3季度期间最终跑输了业绩基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，本基金份额净值为1.193元，累计净值为1.193 元。本报告期份额净值增长率为-29.03%，同期业绩比较基准增长率为-22.96%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望4季度，经济数据有企稳迹象，政府的稳增长力度可能加大，市场对经济预期逐步稳定。在稳增长基础上促改革的大背景下，传统行业压力仍然较大，落后产能逐步被淘汰，行业集中度将提高，盈利有所改观，但过程将很缓慢。代表未来方向的新兴行业，占比将逐步上升，但受稳增长的制约，同样可能不快。在经济运行下台阶、改革不断推进，流动性适度宽松，风险偏好逐步恢复的情形下证券市场呈现震荡上行的态势可能性很大。而稳增长、促改革并进，使新兴行业和有改革预期的传统蓝筹交替表现。

我们一直坚信“持续的成长”能够穿越经济的周期。目前经济环境下，坚定看好“持续稳定成长”的行业和代表新经济行业的投资机会，包括医药、信息服务、大众消费、以及高端装备等新兴产业，还有解决环保根源问题的能源结构相关产业。为此，本基金将继续精选优质个股，持续跟踪，在优质公司持续成长中获得确定收益，力求避免短期波动对长期投资的扰动，获得长期稳定收益。

§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	76,625,680.00	81.58
	其中：股票	76,625,680.00	81.58
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,225,321.76	10.89
7	其他各项资产	7,081,230.09	7.54
8	合计	93,932,231.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,782,500.00	4.07
B	采矿业	-	
C	制造业	34,379,480.00	36.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,426,100.00	16.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,728,300.00	12.61
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	1,619,000.00	1.74
L	租赁和商务服务业	4,020,000.00	4.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,670,300.00	6.09
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	76,625,680.00	82.35

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	600594	益佰制药	330,000	5,237,100.00	5.63
2	002630	华西能源	460,000	4,324,000.00	4.65
3	600483	福能股份	300,000	4,122,000.00	4.43
4	600138	中青旅	200,000	4,020,000.00	4.32
5	002104	恒宝股份	250,000	3,902,500.00	4.19
6	002714	牧原股份	85,000	3,782,500.00	4.07
7	600697	欧亚集团	160,000	3,704,000.00	3.98
8	002573	国电清新	210,000	3,702,300.00	3.98
9	600979	广安爱众	600,000	3,678,000.00	3.95
10	600511	国药股份	120,000	3,519,600.00	3.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金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序的前五名债券投资明细

本基金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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金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。

5.8 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

本基金报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	103,448.93
2	应收证券清算款	6,946,241.98
3	应收股利	-
4	应收利息	1,934.27
5	应收申购款	29,604.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,081,230.09

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有处于转股的可换债券。

5.11.5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。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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	84,995,483.43
本报告期基金总申购份额	52,900,784.02
减：本报告期基金总赎回份额	59,882,301.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,013,966.37

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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优选30股票型证券投资基金募集的批复。

2、《诺德优选30混合型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德优选30混合型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、诺德优选30混合型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，Email：service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日

诺德增强收益债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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：二〇一五年十月二十七日

§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2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德增强收益债券
场内简称	/
基金主代码	573003
交易代码	573003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月4日
报告期末基金份额总额	107,318,245.04份
投资目标	本基金为主动式管理的债券型基金，主要通过全面投资于各类债券品种，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，为基金份额持有人获得较好的全面投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
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。 本基金对非债券产品的直接投资首选在一级市场上的新股申购(含增发)，如果新股的收益率降低，根据风险和收益的配比原则，本基金将参与二级市场的股票买卖。
业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，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	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（2015年7月1日-2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-18,142,078.98
2.本期利润	-3,821,178.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0360
4.期末基金资产净值	120,041,328.63
5.期末基金份额净值	1.119

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

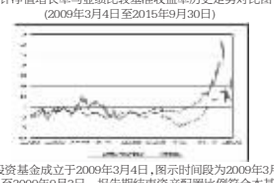
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.03%	1.05%	-1.83%	0.35%	-1.20%	0.70%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

诺德增强收益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

(2009年3月4日至2015年9月30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2015年9月30日。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		
赵滔滔	本基金基金经理、诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)基金经理	2010-06-23	-	8	上海财经大学金融学硕士。2006年11月至2008年10月，任职于平安资产管理有限责任公司。2008年10月加入诺德基金管理有限公司，担任债券交易员，固定收益研究员等职务，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》、《公开募集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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年3季度债券市场继续小幅上涨，主要是股灾发生后银行理财资金的资产配置方向从股市配资、打新等市场撤出进入债券市场，从而推动债券市场供求关系发生变化导致债券市场上涨。另外，3季度央行再次降息降准，资金利率进一步降低，打开了债券息差投资策略的空间，进一步加大