

诺德优选30混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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：二〇一六年一月二十一日重要提示
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2016年1月20日复核了本报告中的财务数据、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。

基金管理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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	诺德优选30混合
基金代码	670007
交易代码	670007
基金运作方式	契约型开放式
基金经理生效日	2011年6月6日
报告期末基金份额总额	65,689,473.02份

本基金占比重不超过50%；其中股票投资比例为20%

风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的理财产品。

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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-436,624.18
2.本期利润	22,268,672.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.3144
4.期末基金份额净值	97,998,900.48
5.期末基金净值	1,492

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

前一月 净值增长率(%) 净值增长率标准差 (%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.012% 0.360% 0.0000% 0.0400% 0.012%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其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图对比图

(2015年5月5日至2015年12月31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12月31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(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	离任日期	说明
李圣勇	本基金基金经理	2013-06-28	-	男，二级硕士，农林牧渔业学士，2009年12月加入诺德基金管理有限公司从事研究工作，先后担任了公司的研究员、基金经理助理、基金经理等职务，现任公司基金经理。李圣勇先生于2011年6月6日开始担任本基金基金经理，2013年6月28日开始担任本基金基金经理，2015年6月6日开始担任诺德正源货币市场基金基金经理，2015年12月28日开始担任诺德正源货币市场基金基金经理，2016年1月21日开始担任诺德精选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完毕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合规性情况的说明
报告期内，本基金基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金管理法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管机构的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理运作基金资产，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情况。

4.3 公平交易执行的专项说明

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，通过比例分配的原则在基金公司内部分配交易量。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

本公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金行业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，对发现的异常交易行为进行公告，该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与定期报告、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，本基金未参与交易所公开的同向或反向交易，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4季度，经济数据依然疲弱，运行支撑力量加大，改革阻力也加大，政策托底力度也随之下降。十八届五中全会以后，市场对于经济预期有所恢复，但这一预期点是改革、创新、市场预期逐步加强，因此，市场的风格也有所改善，但市场的反弹力度仍然较小，震荡市逐步上升，个别互联网+行业可能脱颖而出，但整体的结构性行情可能不如预期。在经济运行下台阶阶段不断推升，流动性适度宽松、风险偏好逐步恢复的情况下，证券市场呈现震荡上行的态势，成交量很大，而涨幅增长，低估值品种可能表现更佳。随着新行业和改革预期的持续蓝筹将交替表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为1.492元，累计净值为1.492元。本报告份额净值增长率为2.0%，期间回报率基准增长率为13.18%。

4.5 管理人对宏观经济的展望

展望2016年，经济数据仍然可能低于底线，政府的稳增长力度可能加大，供给侧改革有可能使市场价格出现阶段性反弹，但幅度可能有所改善，但市场的反弹力度仍然较小，震荡市逐步上升，个别互联网+行业可能脱颖而出，但整体的结构性行情可能不如预期。在经济运行下台阶阶段不断推升，流动性适度宽松、风险偏好逐步恢复的情况下，证券市场呈现震荡上行的态势，成交量很大，而涨幅增长，低估值品种可能表现更佳。随着新行业和改革预期的持续蓝筹将交替表现。

4.6 报告期内基金的费用情况说明

4.6.1 基金管理费

4.6.2 基金托管费

4.6.3 基金销售服务费

4.6.4 基金份额申购、赎回费

4.6.5 基金转换费

4.6.6 基金上市费

4.6.7 基金分红费

4.6.8 基金持有人交易费

4.6.9 基金持有人退出费

4.6.10 基金持有人赎回费

4.6.11 基金持有人转换费

4.6.12 基金持有人赎回费

4.6.13 基金持有人赎回费

4.6.14 基金持有人赎回费

4.6.15 基金持有人赎回费

4.6.16 基金持有人赎回费

4.6.17 基金持有人赎回费

4.6.18 基金持有人赎回费

4.6.19 基金持有人赎回费

4.6.20 基金持有人赎回费

4.6.21 基金持有人赎回费

4.6.22 基金持有人赎回费

4.6.23 基金持有人赎回费

4.6.24 基金持有人赎回费

4.6.25 基金持有人赎回费

4.6.26 基金持有人赎回费

4.6.27 基金持有人赎回费

4.6.28 基金持有人赎回费

4.6.29 基金持有人赎回费

4.6.30 基金持有人赎回费

4.6.31 基金持有人赎回费

4.6.32 基金持有人赎回费

4.6.33 基金持有人赎回费

4.6.34 基金持有人赎回费

4.6.35 基金持有人赎回费

4.6.36 基金持有人赎回费

4.6.37 基金持有人赎回费

4.6.38 基金持有人赎回费

4.6.39 基金持有人赎回费

4.6.40 基金持有人赎回费

4.6.41 基金持有人赎回费

4.6.42 基金持有人赎回费

4.6.43 基金持有人赎回费

4.6.44 基金持有人赎回费

4.6.45 基金持有人赎回费

4.6.46 基金持有人赎回费

4.6.47 基金持有人赎回费

4.6.48 基金持有人赎回费

4.6.49 基金持有人赎回费

4.6.50 基金持有人赎回费

4.6.51 基金持有人赎回费

4.6.52 基金持有人赎回费

4.6.53 基金持有人赎回费

4.6.54 基金持有人赎回费

4.6.55 基金持有人赎回费

4.6.56 基金持有人赎回费

4.6.57 基金持有人赎回费

4.6.58 基金持有人赎回费

4.6.59 基金持有人赎回费

4.6.60 基金持有人赎回费

4.6.61 基金持有人赎回费

4.6.62 基金持有人赎回费

4.6.63 基金持有人赎回费

4.6.64 基金持有人赎回费

4.6.65 基金持有人赎回费

4.6.66 基金持有人赎回费

4.6.67 基金持有人赎回费

4.6.68 基金持有人赎回费

4.6.69 基金持有人赎回费

4.6.70 基金持有人赎回费

4.6.71 基金持有人赎回费

4.6.72 基金持有人赎回费

4.6.73 基金持有人赎回费

4.6.74 基金持有人赎回费

4.6.75 基金持有人赎回费

4.6.76 基金持有人赎回费

4.6.77 基金持有人赎回费

4.6.78 基金持有人赎回费

4.6.79 基金持有人赎回费

4.6.80 基金持有人赎回费

4.6.81 基金持有人赎回费

4.6.82 基金持有人赎回费

4.6.83 基金持有人赎回费

4.6.84 基金持有人赎回费

4.6.85 基金持有人赎回费