诺德优选30股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

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：二〇一二年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2012年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	诺德优选30股票
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	710,941,648.55份

2.2基金产品说明

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	沪深300指数×80%+同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金为持股相对集中的股票型证券投资基金，是证券投资基金中的较高风险品种。长期平均风险和预期收益均高于一般的股票型基金、混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张欣	唐州徽
	联系电话	021-68879999	010-66594855
	电子邮箱	xin.zhang@lordabbettchina.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68877727	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

2.5其他相关资料

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	-38,853,475.23
本期利润	9,594,616.24
加权平均基金份额本期利润	0.0129
本期基金份额净值增长率	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.1983
期末基金资产净值	569,972,914.77
期末基金份额净值	0.802

注：1、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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数），表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3、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。

4、本基金合同生效日为2011年5月5日。

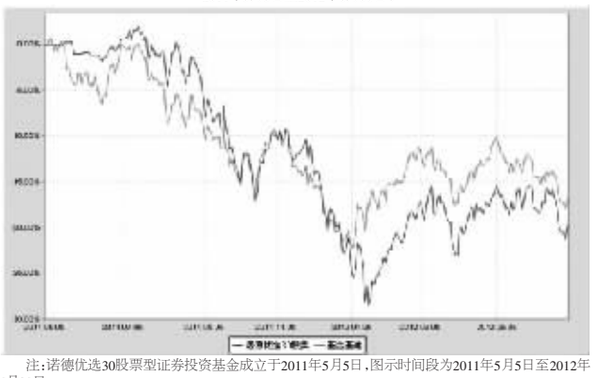
3.2基金净值表现

3.2.1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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-5.20%	1.14%	-5.18%	0.87%	-0.02%	0.27%
过去三个月	4.29%	1.15%	0.31%	0.90%	3.98%	0.25%
过去六个月	1.52%	1.35%	4.18%	1.06%	-2.66%	0.29%
过去一年	-19.48%	1.27%	-15.20%	1.08%	-4.28%	0.19%
自基金合同生效起至今	-19.80%	1.18%	-17.00%	1.05%	-2.80%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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股票型证券投资基金
份额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2012年6月30日）



注：诺德优选30股票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2012年6月30日。

本基金建仓期间自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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基字〔2006〕88号文批准设立。公司股东为诺德、安博特资产管理公司（Lord，Abbett & Co.，LLC）、长江证券股份有限公司、清华控股有限公司，注册地为上海，注册资本为1亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了八只开放式基金：诺德价值优势股票型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势股票型证券投资基金、诺德中小盘股票型证券投资基金、诺德优选30股票型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、诺德周期策略股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
向朝勇	本基金基金经理，诺德中小盘股票型证券投资基金基金经理	2011-05-05	2012-06-14	15	中山大学管理学院管理学博士。历任平安证券资产管理事业部及投资管理部研究员、二级部门研究部经理、交易室主任及投资管理部总经理助理；东吴证券有限公司投资总部副总经理；东吴基金管理公司投资管理部总经理；新华基金管理有限公司总经理助理、投资总监、副总经理。2005年2月1日至2006年10月9日，担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，2007年6月19日至2009年9月22日担任新华优选分红混合型证券投资基金基金经理。2009年10月加入诺德基金管理有限公司，具有基金从业资格。
张辉	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	2011-05-05	-	15	纽约大学（New York University）工商管理硕士（MBA）。1994年起历任美国JP摩根（JP Morgan）高级经理，美国高盛（Goldman Sachs）副总裁等职。2007年9月加入诺德基金管理有限公司，先后担任公司投资研究部行业研究员，基金经理助理等职务。具有基金从业资格和特许金融分析师（CFA）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。

经诺德基金管理有限公司总经理办公会研究决定，自2012年6月14日起，向朝勇先生不再担任本基金基金经理职务，由张辉先生单独管理本基金。

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》、《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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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管理人对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

今年上半年国外经济与政治形势持续动荡，国内宏观经济逐步下行，通货膨胀率同比也继续走低，政策上继续以稳健为主，股市小幅上涨。一季度房地产，券商等周期性行业走势相对较强，中小盘成长股补跌；二季度食品饮料、医药等消费与成长行业也不断跟上，其中白酒与高端消费电子等子行业涨幅领先。

本基金在报告期内坚持成长性投资策略，周期与非周期并重，以精选个股为主。由于在经济下滑过程中企业优胜劣汰分化加速，成长性股票波动较大。一季度在稀土与房地产等周期行业上收益较多，二季度在券商与食品饮料等行业上也有较好收获。虽然二季度基金业绩也大幅跑赢业绩基准，但由于一季度重仓中小盘成长股及消费行业损失较大，致使上半年基金总体业绩跑输基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年06月30日，本基金份额净值为 0.802元，累计净值为 0.802元。本报告期份额净值增长率为1.52%，同期业绩比较基准增长率为4.18%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济预计将筑底回升，通货膨胀也将持续走低至四季度左右，市场预期政策空间也逐步放开。但在经济转型与可能的弱复苏周期格局下，加上国际市场的持续不稳定，预计市场的不确定性与波动性可能会明显提高。我们维持对市场结构性牛市的判断，并将坚持成长性投资策略，相对看好得益于经济转型的高科技与高端制造业。同时也关注经济周期复苏带动的周期性行业股票的反转机会，力争获取超额收益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为了确保基金估值严格执行新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，更好地保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人制定并修订了《诺德基金管理有限公司证券投资基金估值制度》（以下简称“估值制度”。）

根据估值制度，基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资研究部总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成，所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中：

基金会计主管主要负责制定新的估值政策、方法和程序，提供相关的会计数据，并具体负责和会计事务所及基金托管行就估值模型、假设及参数进行沟通，以支持委员会的相关决定；

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施；

投资研究部总监主要负责分析市场情况，并在结合相关行业研究员意见的基础上对具体投资品种所处的经济环境和相关重大事项进行判断；

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性，以及负责具体信息披露工作。

根据估值制度，估值委员会成员中不包括基金经理。本报告期内，上述参与流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诺德中小盘股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：诺德优选30股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	17,050,742.96	27,798,767.03
结算备付金		7,488,825.10	6,376,772.69
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	497,716,691.88	515,070,662.59
其中：股票投资		466,625,255.88	504,406,690.59
基金投资		-	-
债券投资		31,091,436.00	10,663,972.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,000,000.00	-
应收证券清算款		-	62,698,894.48
应收利息	6.4.7.5	232,392.59	202,782.58
应收股利		-	-
应收申购款		2,371.53	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		572,491,024.06	612,147,879.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,231,708.68
应付赎回款		579,895.21	311,041.39
应付管理人报酬		723,714.93	808,851.35
应付托管费		120,619.17	134,808.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	793,963.47	578,142.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	299,916.51	321,172.26
负债合计		2,518,109.29	9,385,724.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	710,941,648.55	762,744,085.80
未分配利润	6.4.7.10	-140,968,733.78	-159,981,930.99
所有者权益合计		569,972,914.77	602,762,154.81
负债和所有者权益总计		572,491,024.06	612,147,879.37

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.802元，基金份额总额710,941,648.55份。

6.2利润表

会计主体：诺德优选30股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年5月5日（基金合同生效日）至2011年6月30日
一、收入		17,987,496.72	-2,902,430.35
1.利息收入		1,190,081.59	2,509,495.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	177,645.69	685,615.71
债券利息收入		325,318.86	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		687,117.04	1,823,879.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-31,698,781.25	-7,606,173.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-33,531,615.99	-8,519,816.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	83,536.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,749,298.74	913,643.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	48,448,091.47	1,858,944.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	48,104.91	335,302.69
减：二、费用		8,392,880.48	4,030,200.73
1.管理人报酬		4,447,968.43	2,621,820.62
2.托管费		741,328.10	436,970.12
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	2,972,196.21	889,384.28
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	231,387.74	82,025.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,594,616.24	-6,932,631.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,594,616.24	-6,932,631.08

注：本基金合同生效日为2011年5月5日。

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德优选30股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	762,744,085.80	-159,981,930.99	602,762,154.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,594,616.24	9,594,616.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-51,802,437.25	9,418,580.97	-42,383,856.28
其中：1.基金申购款	7,951,802.12	-1,512,714.00	6,439,088.12
2.基金赎回款	-59,754,239.37	10,931,294.97	-48,822,944.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	710,941,648.55	-140,968,733.78	569,972,914.77

项目	上年度可比期间 2011年5月5日（基金合同生效日）至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,181,283,217.92	-	1,181,283,217.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,932,631.08	-6,932,631.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-252,566,305.42	3,431,270.08	-249,135,035.34
其中：1.基金申购款	207,832.13	-1,866.01	205,966.12
2.基金赎回款	-252,774,137.55	3,433,136.09	-249,341,001.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	928,716,912.50	-3,501,361.00	925,215,551.50

注：1、本基金合同生效日为2011年5月5日。

2、报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.3，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：潘福祥，主管会计工作负责人：潘福祥，会计机构负责人：虞俏依

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德优选 30股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2011〕320号《关于核准诺德优选 30股票型证券投资基金募集的批复》核准，由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《诺德优选 30股票型证券投资基金基金合同》和《诺德优选 30股票型证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,180,935,449.27元，业经普华永道中天验字（2011）第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德优选 30股票型证券投资基金基金合同》于2011年5月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,181,283,217.92份基金份额，其中认购资金利息折合347,768.65份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《诺德优选 30股票型证券投资基金基金合同》和最新公布的《诺德优选 30股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的A 股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投占基金资产净值的比例范围为60-95%，其中投资于基金持仓权重前30 位股票的资产占股票资产的比例不低于80%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的比例范围为5-40%；其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。业绩比较基准为：沪深300 指数×80%+同业存款利率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告〔2010〕5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德优选30股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年1月1日至2012年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金未发生会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金未发生会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金未发生会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2005〕102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔2005〕107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
Lord Abbett & Co. LLC	基金管理人的股东
清华控股有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间内，本基金未通过关联方交易单元进行交易业务。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年5月5日（基金合同生效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,447,968.43	2,621,820.62
其中：支付销售机构的客户维护费	2,102,333.02	1,240,650.15

注：支付基金管理人诺德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年5月5日（基金合同生效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	741,328.10	436,970.12

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期及上年度可比期间内，本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期末，本基金其他关联方未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年5月5日（基金合同生效日）至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	17,050,742.96	129,718.98	248,725,782.49	674,981.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内，本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间内，本基金未发生其他需要说明的关联方交易。

6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本报告期末本基金未从事债券正回购交易，无质押债券。

7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	466,625,255.88	81.51
	其中：股票	466,625,255.88	81.51
2	固定收益投资	31,091,436.00	5.43
	其中：债券	31,091,436.00	5.43
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	8.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,539,568.06	4.29
6	其他各项资产	234,764.12	0.04
7	合计	572,491,024.06	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,841,012.30	1.73
B	采掘业	38,169,334.41	6.70
C	制造业	173,913,433.29	30.51
C0	食品、饮料	90,094,492.24	15.81
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	9,131,272.92	1.60
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	26,532,978.90	4.66
C6	金属、非金属	9,124,785.00	1.60
C7	机械、设备、仪表	16,394,319.23	2.88
C8	医药、生物制品	22,635,585.00	3.97
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	53,425,939.66	9.37
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	21,719,276.40	3.81
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	62,579,354.43	10.98
J	房地产业	88,495,388.21	15.53
K	社会服务业	13,310,577.18	2.34
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,170,940.00	0.91
	合计	466,625,255.88	81.87

7.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600369	西南证券	2,678,415	30,292,873.65	5.31
2	000413	宝 石A	2,227,790	26,532,978.90	4.66
3	000546	光华控股	3,472,892	24,761,719.96	4.34
4	000609	绵世股份	3,416,773	24,669,101.06	4.33
5	600397	安源股份	1,724,853	23,147,527.26	4.06
6	002004	华邦制药	1,006,026	22,635,585.00	3.97
7	000426	兴业矿业	1,125,229	15,021,807.15	2.64
8	600809	山西汾酒	393,442	14,828,828.98	2.60
9	300300	汉鼎股份	475,451	11,757,903.23	2.06
10	000799	酒 鬼 酒	222,815	11,675,506.00	2.05

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000413	宝 石A	30,045,104.93	4.98
2	600397	安源股份	29,794,508.10	4.94
3	000546	光华控股	29,766,715.30	4.94
4	000609	绵世股份	27,877,825.13	4.63
5	000656	金科股份	27,536,736.33	4.57
6	600369	西南证券	27,130,907.02	4.50
7	600636	三爱富	22,186,554.45	3.68
8	002004	华邦制药	20,686,351.89	3.43
9	600031	三一重工	19,488,817.64	3.23
10	600809	山西汾酒	18,668,982.03	3.10
11	600111	包钢稀土	18,470,735.79	3.06
12	600883	博闻科技	17,278,123.67	2.87
13	000426	兴业矿业	16,493,600.63	2.74
14	600693	东百集团	15,899,325.17	2.64
15	000869	张 裕A	15,727,763.28	2.61
16	600160	巨化股份	15,211,563.61	2.52
17	600695	大江股份	14,994,002.98	2.49
18	000411	英特集团	14,366,666.52	2.38
19	600568	中珠控股	14,006,946.23	2.32
20	600519	贵州茅台	13,670,722.55	2.27
21	600734	实达集团	13,315,632.41	2.21
22	600167	联美控股	12,962,444.86	2.15
23	000623	吉林敖东	12,768,647.10	2.12

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	63,679,118.74	10.56
2	000858	五 粮 液	43,783,323.48	7.26
3	600809	山西汾酒	38,642,974.75	6.41
4	601566	九牧王	38,369,111.28	6.37
5	600111	包钢稀土	33,366,804.49	5.54
6	002293	罗莱家纺	31,659,171.88	5.25
7	000423	东阿阿胶	30,924,252.26	5.13
8	000656	金科股份	30,831,085.98	5.11
9	002353	杰瑞股份	29,184,208.23	4.84
10	600636