诺德中小盘股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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:二〇一三年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2013年8月26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2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺德中小盘股票
基金主代码	570006
交易代码	570006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月28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	236,843,074.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注行业生命周期中处于成长期的公司,主要投资于具备核心竞争力的高成长型中小市值上市公司,同时也投资于具有估值优势的非成长型中小市值公司和大市值上市公司,分享中国经济和资本市场高速发展的成果。基于对世界和中国经济增长和产业结构变迁、全球技术创新和商业模式演化、上市公司争夺和把握成长机遇能力等因素的深入分析,在有效控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金将主要通过在宏观、行业、公司不同层次上的深入研究,寻找具有核心竞争力的成长型中小市值企业的股票进行投资,同时,鉴于股票市场与生俱来的波动性和周期性,本基金也会选择具有估值优势的非成长型中小市值股票和大市值股票进行投资。本基金将在充分考虑预期收益与风险的基础上,构建投资组合。
业绩比较基准	中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于中小盘股票,在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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	95566
	电子邮箱	alan.chang@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(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	29,735,574.37
本期利润	18,344,607.10
加权平均基金份额本期利润	0.0687
本期基金份额净值增长率	6.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0489
期末基金资产净值	225,259,198.52
期末基金份额净值	0.951

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。

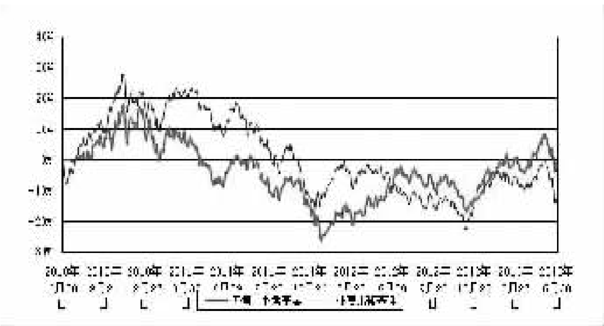
3.2 基金净值表现

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	-8.65%	1.61%	-12.48%	1.55%	3.83%	0.06%
过去三个月	-1.35%	1.27%	-5.85%	1.21%	4.50%	0.06%
过去六个月	6.26%	1.20%	-2.58%	1.17%	8.84%	0.03%
过去一年	4.28%	1.11%	-5.12%	1.14%	9.40%	-0.03%
过去三年	-2.23%	1.23%	-7.52%	1.19%	5.29%	0.04%
自基金合同生效起至今	-2.23%	1.23%	-13.32%	1.20%	11.09%	0.03%

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

诺德中小盘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
(2010年6月28日至2013年6月30日)



注:"诺德中小盘股票型证券投资基金成立于2010年6月28日,图示时间段为2010年6月28日至2013年6月30日。

本基金建仓期间自2010年6月28日至2010年12月27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金字[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,公司管理了九只开放式基金: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、诺德深证300指数分级证券投资基金。

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		
周勇	本基金基金经理、研究副总监	2012-06-14	-	9	复旦大学经济学硕士。2010年5月加盟诺德基金管理有限公司,担任研究副总监。周勇先生曾先后任职于长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司从事投资策略研究工作。

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》、《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

2013年上半年A股市场呈现冲高回落走势,但内部结构分化非常严重。年初经济弱复苏预期让周期股有短暂反弹,但是随之而来的经济数据持续低预期并叠加季末流动性紧张等因素的冲击下,A股市场呈现破位下行之势,金融地产、煤炭有色等周期性行业领跌大盘。但是,TMT、医药、环保等成长性行业在业绩超预期和政策扶持下引领创业板指数持续上行,大小盘之间的风格分化渐趋极致。

本基金秉承一贯的"立足精选业绩确定性较高个股"的投资风格,今年上半年一直在坚持适度控制仓位,但风格偏向成长的投资策略,继续重点配置医药、传媒、电子等成长性行业的优质个股,同时坚决回避了金融地产等强周期行业。因此,在上半年在市场整体投资风格持续偏向成长股的背景下,本基金上半年业绩大幅跑赢比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年06月30日,本基金份额净值为0.951元,累计净值为0.981元。本报告期份额净值增长率为6.26%,同期业绩比较基准增长率为-2.58%。

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2013年下半年,我们依然将经济周期、政策预期以及物价房价走势这三大变量作为考察A股市场能否真正构筑坚实底部的核心要素。今年上半年市场对经济周期和宏观政策的预期经历了从乐观到谨慎的巨大调整,这是导致上半年A股市场冲高回落的根本原因。我们预期,下半年通胀以及流动性的预期差将取代经济周期和宏观政策的预期差,成为决定A股市场整体走向的关键变量。

本基金一直坚信,在大的经济周期没有发生改变之前,未来较长一段时间内的投资机会依然集中在稳定成长的消费类行业及国家政策长期重点扶持的新兴产业如TMT及高端装备等行业。但考虑到上半年日趋严重的风格分化特征以及下半年流动性可能整体偏紧的预期,我们倾向于认为市场的风格分化可能在某个时点出现阶段性收敛。因此本基金将坚持在适度仓位控制的基础上,强化对个股的跟踪力度,进一步优中选优,并充分警惕阶段性的风格转换,争取在力求保持原有投资风格的同时,避免基金净值的大幅波动,从而获取长期稳定的超额收益。

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:诺德中小盘股票型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末2013年6月30日	上年度末2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	15,596,219.86	17,208,017.61
结算备付金		2,383,725.57	3,820,713.30
存出保证金		88,778.03	3,750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	194,791,778.12	207,080,885.74
其中:股票投资		194,791,778.12	207,080,885.74
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	15,000,000.00	36,000,000.00
应收证券清算款		-	4,104,045.89
应收利息	6.4.7.5	6,400.48	13,344.04
应收股利		162,075.41	-
应收申购款		8,690.98	29,666.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		228,037,668.45	272,006,673.56
负债和所有者权益	附注号	本期末2013年6月30日	上年度末2012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		90,694.44	1,569,072.50
应付赎回款		165,444.00	707,021.20
应付管理人报酬		292,436.03	321,432.65
应付托管费		48,739.34	53,572.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	180,076.10	243,107.34
应交税费		12,075.20	12,075.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,989,004.82	4,171,754.40
负债合计		2,778,469.93	7,078,035.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	236,843,074.30	295,954,656.89
未分配利润	6.4.7.10	-11,583,875.78	-31,026,018.71
所有者权益合计		225,259,198.52	264,928,638.18
负债和所有者权益总计		228,037,668.45	272,006,673.56

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.951元,基金份额总额236,843,074.30份。

6.2 利润表

会计主体:诺德中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		21,280,755.67	30,207,878.52
1.利息收入		675,222.01	300,542.70
其中:存款利息收入	6.4.7.11	162,227.54	84,232.71
债券利息收入		193.58	37,230.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		512,800.89	179,079.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		31,973,055.39	-17,376,760.67
其中:股票投资收益	6.4.7.12	30,911,386.30	-18,427,347.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	44,702.42	-
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	1,016,966.67	1,050,586.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-11,390,967.27	47,267,337.93
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	23,445.54	16,758.56
减:二、费用		2,936,148.57	3,257,796.56
1.管理人报酬		1,914,052.22	1,761,387.27
2.托管费		319,008.70	293,564.52
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	506,463.51	983,867.64
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	196,624.14	218,977.13
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		18,344,607.10	26,950,081.96
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		18,344,607.10	26,950,081.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺德中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	295,954,656.89	-31,026,018.71	264,928,638.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,344,607.10	18,344,607.10
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)	-59,111,582.59	1,097,535.83	-58,014,046.76
其中:1.基金申购款	8,701,691.00	-214,450.63	8,487,240.37
2.基金赎回款	-67,813,273.59	1,311,986.46	-66,501,287.13
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)	236,843,074.30	-11,583,875.78	225,259,198.52
项目	上年度可比期间 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)	301,436,835.34	-55,475,378.34	245,961,457.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,950,081.96	26,950,081.96
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)	-19,712,465.94	3,646,602.13	-16,065,863.81
其中:1.基金申购款	9,044,449.56	-1,551,354.92	7,493,094.64
2.基金赎回款	-28,756,915.50	5,197,957.05	-23,558,958.45
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)	281,724,369.40	-24,878,694.25	256,845,675.15

报告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:

基金管理人负责人:潘福祥,主管会计工作负责人:潘福祥,会计机构负责人:高奇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德中小盘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?2010]第270号《关于核准诺德中小盘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》和《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集363,552,185.17元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第169号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为363,570,378.53份基金份额,其中认购资金利息折合18,193.36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》和《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》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他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产投资比例占基金资产的60%-95%;债券、债券回购、银行存款等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的5%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金投资权证的比例不超过资产的3%。自2011年7月1日起,本基金业绩比较基准由原来的"天相中盘指数×40%+天相小盘指数×40%+上证国债指数×20%"变更为"中证700指数×80%+上证国债指数×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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德中小盘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2013年1月1日至2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期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[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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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 &amp; 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

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	-	-	27,144,801.60	4.21%

6.4.8.1.2权证交易

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权证交易业务。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	22,055.37	4.14%	-	-

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,914,052.22	1,761,387.27
其中:支付销售机构的客户维护费	620,728.25	557,307.73

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2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	319,008.70	293,564.52

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

份额单位:份

项目	本期2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	10,000,400.04	10,000,400.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,400.04	10,000,400.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.22%	3.55%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	15,596,219.86	136,381.51	19,855,142.90	68,324.38

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(2013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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600547	山东黄金	2013-04-03	重大资产重组	24.29	2013-07-01	28.77	281,400	10,597,216.98	6,835,206.00	-
002322	理工监测	2013-06-06	重大资产重组	13.40	2013-08-08	13.80	440,000	4,817,851.52	5,896,000.00	-

注:本基金截至2013年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未从事债券正回购交易,无质押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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	194,791,778.12	85.42
	其中:股票	194,791,778.12	85.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	15,000,000.00	6.58
	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	17,979,945.43	7.88
6	其他各项资产	265,944.90	0.12
7	合计	228,037,668.45	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	1,698,400.00	0.75
B	采矿业	6,835,206.00	3.03
C	制造业	132,810,987.40	58.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,322,605.72	5.47
F	批发和零售业	9,422,532.54	4.18
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	10,687,962.00	4.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,408,466.56	3.29
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	13,605,617.90	6.04
S	综合	-	-
	合计	194,791,778.12	86.47

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	000423	东阿阿胶	352,495	13,634,506.60	6.05
2	601098	中南传媒	1,142,063	10,621,185.90	4.72
3	600062	华润双鹤	528,191	10,574,383.82	4.69
4	600518	康美药业	499,998	9,614,961.54	4.27
5	600079	人福医药	360,000	9,388,800.00	4.17
6	600261	阳光照明	682,000	8,647,760.00	3.84
7	300079	数码视讯	400,433	8,393,075.68	3.73
8	600703	三安光电	407,121	7,995,856.44	3.55
9	601222	林洋电子	500,245	7,473,660.30	3.32
10	000430	张家界	1,076,812	7,408,466.56	3.29

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	600062	华润双鹤	12,859,168.90	4.85
2	000430	张家界	8,750,518.94	3.30
3	600079	人福医药	8,635,195.89	3.26
4	601222	林洋电子	8,602,986.66	3.25
5	002322	理工监测	8,520,523.70	3.22
6	600261	阳光照明	8,263,366.00	3.12
7	002056	横店东磁	8,221,585.67	3.10
8	600418	江淮汽车	7,460,045.25	2.82
9	601098	中南传媒	7,418,879.00	2.80
10	002586	围海股份	7,154,217.89	2.70
11	300139	福星晓程	4,447,412.16	1.68
12	601933	永辉超市	4,042,889.33	1.53
13	002226	江南化工	3,991,280.98	1.51
14	300024	机器人	3,915,297.97	1.48
15	300074	华平股份	3,759,996.00	1.42
16	002172	澳洋科技	3,633,526.06	1.37
17	002630	华西能源	3,620,931.08	1.37
18	300088	长信科技	3,479,723.50	1.31
19	000625	长安汽车	3,384,000.00	1.28
20	002550	千红制药	3,147,923.00	1.19

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	600422	昆明制药	13,188,802.04	4.98
2	300039	上海凯宝	13,081,327.90	4.94
3	002344	海宁皮城	12,185,921.98	4.60
4	600373	中文传媒	11,529,513.39	4.35
5	600703	三安光电	10,133,062.10	3.82
6	600104	上汽集团	10,115,476.26	3.82
7	600741	华域汽车	8,209,978.40	3.10
8	300267	尔康制药	8,188,104.82	3.09
9	600637	百视通	8,008,443.16	3.02
10	300314	戴维医疗	7,986,824.73	3.01
11	601098	中南传媒	7,337,091.71	2.77
12	002273	水晶光电	7,071,408.10	2.67
13	002475	立讯精密	5,711,358.88	2.16
14	002322	理工监测	5,439,592.38	2.05
15	300088	长信科技	5,222,769.40	1.97
16	300079	数码视讯	5,152,281.80	1.94
17	002172	澳洋科技	4,182,419.75	1.58
18	601515	东风股份	4,052,575.30	1.53
19	300074	华平股份	4,049,610.00	1.53
20	600502	安徽水利	3,753,928.98	1.42

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	145,481,956.82
卖出股票的收入(成交)总额	177,291,483.47

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	88,778.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	162,075.41
4	应收利息	6,400.48
5	应收申购款	8,690.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,944.90

7.9.4 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换债券。

7.9.5 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情况。

8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,586	42,399.40	14,925,875.45	6.30%	221,917,198.85	93.70%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	474,221.13	0.2%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间:0至10万份(含);

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间:0 。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年6月28日)基金份额总额	363,570,378.53
本报告期期初基金份额总额	295,954,656.89
本报告期基金总申购份额	8,701,691.00
减:本报告期基金总赎回份额	67,813,273.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	236,843,074.30

注:总申购份额包含转换入份额;总赎回份额含转换出份额

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2013年3月17日,根据国家金融工作需要,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

2013年6月1日,中国银行股份有限公司发布公告,自2013年5月31日起,田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所有限公司担任本基金2013年度的基金审计机构。普华永道中天会计师事务所有限公司担任过本基金募集的验资机构,提供相关服务。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情形。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	148,867,352.97	46.12%	135,529.75	46.29%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	8,435,228.06	2.61%	7,464.29	2.55%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	24,635,723.27	7.63%	22,233.65	7.59%	-
国海证券	2	136,222,230.91	42.20%	123,339.08	42.13%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	4,612,905.08	1.43%	4,199.58	1.43%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
合计	27	322,773,440.29	100.00%	292,766.35	100.00%	-

注:根据中国证监会的有关规定,基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家证券公司租用了基金交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下:

(1)公司财务状况良好、经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;

2、基金专用交易单元的选择程序如下:

(1)基金管理人根据上述标准考察后,确定选用交易单元的证券经营机构;

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	780,896.00	100.00%	2,866,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
合计	780,896.00	100.00%	2,866,000,000.00	100.00%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

诺德基金管理有限公司
二〇一三年八月二十七日