诺德优选30股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013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股票
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	532,464,069.92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	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。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	16,636,718.50
2.本期利润	39,711,603.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0710
4.期末基金资产净值	437,160,207.46
5.期末基金份额净值	0.821

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

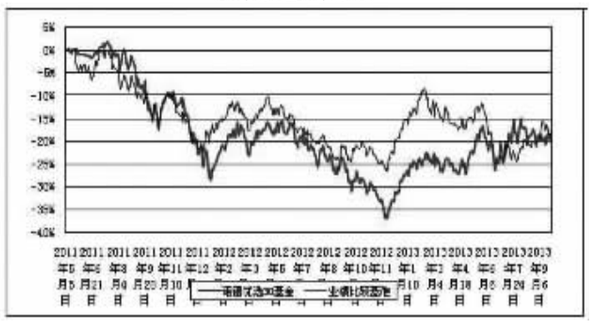
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年7月1日至9月30日	9.18%	1.53%	7.66%	1.15%	1.52%	0.38%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年5月5日至2013年9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2013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		
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	2011-5-5	2013-7-17	16	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。现任本基金基金经理及诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格和特许金融分析师(CFA)资格。
李圣春	本基金基金经理	2013-5-28	-	6	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、上海塔晶投资管理有限公司,具有基金从业资格,现任诺德优选30股票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》、《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

2013年三季度,政府给出经济增长下限,7、8月份经济数据企稳,9月预期向好,短期给了市场一个安全、稳定的大环境。鉴于对经济增长预期的转好,市场出现了风格的转换,传统周期表现良好,成长股受到压制。基于对改革的良好预期,以及自贸区、土地流转等相关政策出台,相关主题表现抢眼。在经历过6月份流动性冲击后,政府对流动性基本保持中性偏紧的态度,这也为三季度市场的良好表现提供了宽松的环境。

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。三季度,在保持仓位基本稳定的基础上,重点配置了医药、环保、信息服务、电子等成长行业,也少量参与了自贸和土地流转等主题机会。虽然三季度整体风格在传统周期和主题投资、成长风格受到压制,但是通过精选个股,本基金业绩最终还是跑赢业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年09月30日,本基金份额净值为 0.821元,累计净值为0.821元。本报告期份额净值增长率为9.18%,同期业绩比较基准增长率为7.66%。

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,由于基数原因,经济数据阶段性反弹将告一段落,仍将低位运行。传统行业盈利改观不大,新兴行业虽然代表转型方向,但占比较小,短期难以拉动作用有限。不过,完成全年的经济增长下限问题不大,市场预期也相对稳定。接近年底,流动性总体偏紧,但政府仍可能保持中性态度。在经济低位运行、流动性偏紧的情形下,证券市场很难有良好表现,呈现震荡调整态势可能性很大。

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、大众消费、信息服务、以及高端装备等新兴产业,还有反应民生的环保相关产业。年初以来成长股累积了较大的超额收益,存在一定的回调风险。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	377,594,036.93	85.64
	其中:股票	377,594,036.93	85.64
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	22,000,000.00	4.99
	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	35,129,229.36	7.97
6	其他各项资产	6,210,270.36	1.41
7	合计	440,933,536.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	230,665,579.29	52.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,372,000.00	5.80
E	建筑业	25,742,200.00	5.89
F	批发和零售业	-	-
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	64,220,632.64	14.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,880,000.00	2.03
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	22,713,625.00	5.20
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	377,594,036.93	86.37

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	600728	佳都新太	2,319,286	33,026,632.64	7.55
2	300039	上海凯宝	1,517,333	23,366,928.20	5.35
3	002023	海特高新	1,420,059	21,769,504.47	4.98
4	600062	华润双鹤	915,881	19,132,754.09	4.38
5	600252	中恒集团	1,200,000	17,940,000.00	4.10
6	600703	三安光电	880,000	17,855,200.00	4.08
7	300335	迪森股份	900,000	17,496,000.00	4.00
8	002573	国电清新	800,000	16,696,000.00	3.82
9	002022	科华生物	880,000	14,740,000.00	3.37
10	300074	华平股份	500,000	14,435,000.00	3.30

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	212,239.18
2	应收证券清算款	5,985,489.97
3	应收股利	-
4	应收利息	12,047.14
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,210,270.36

5.10.4 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换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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在流通受限情况。

§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	578,167,046.28
本报告期基金总申购份额	290,091.60
减:本报告期基金总赎回份额	45,993,067.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	532,464,069.92

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公司管理基金情况

诺德基金管理有限公司本季度末申购或赎回本基金

§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股票型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德优选30股票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股票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@lordabbettchina.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一三年十月二十四日

诺德中小盘股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013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
报告期末基金份额总额	192,635,488.84份
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。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,763,236.04
2.本期利润	26,124,792.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.1188
4.期末基金资产净值	205,039,671.09
5.期末基金份额净值	1.064

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

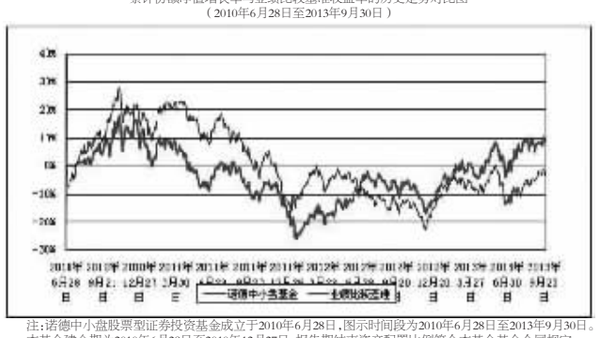
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年7月1日至2013年9月30日	11.88%	1.24%	13.12%	1.11%	-1.24%	0.13%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年6月28日至2013年9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9月30日。

本基金建仓期为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		
周勇	本基金基金经理、研究副总监	2012-6-14	-	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。周勇先生现任诺德中小盘股票型证券投资基金基金经理、研究副总监。

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 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

2013年三季度A股市场结构性牛市特征依然明显,在年中经济数据出现一定改善,金融地产、煤炭有色等强周期股在三季度初有一波表现之后,市场在政策释放强烈改革预期背景下,热点再次转向新兴成长板块以及传统行业中可能受益经济转型的板块,其中信息服务、信息设备等新兴成长行业涨幅居前,而商业贸易、交通运输、餐饮旅游等跟经济转型相关的传统行业也有不错表现,最终建筑建材、煤炭、有色等跟经济周期密切相关的行业表现相对落后。

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,三季度整体风格依然偏向成长,行业配置的重点依然在医药、传媒、电子等行业,但是本基金三季度业绩小幅跑输比较基准,主要原因在于三季度整体仓位偏低。三季度初基于市场的结构分化可能收敛的判断,本基金提早对不少个股进行减持,导致行业配置方向虽然没有偏差,但是提前减仓影响基金的整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年09月30日,本基金份额净值为1.064元,累计净值为1.094 元。本报告期份额净值增长率为11.88%,同期业绩比较基准增长率为13.12%。

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 年四季度,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。尽管三季度市场的结构性牛市与我们年中的预判出现一定偏差,但我们依然相信市场的风格分化难以长期持续,未来一段时间内行业选择的难度将加大,成长性行业的投资策略可能在未来某个时点遭遇曲折。

从长期来看,本基金坚持认为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。但短期而言,考虑到经济复苏的力度可能再度放缓,市场对成长股的偏爱也日趋极致,我们倾向于认为四季度难以出现趋势性行情。因此本基金将坚持在适度仓位控制的基础上,强化对行业的精选和个股的跟踪力度,获取长期稳定的超额收益。

§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	181,988,518.66	85.53
	其中:股票	181,988,518.66	85.53
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	-	-
	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	15,495,195.87	7.28
6	其他各项资产	15,293,122.76	7.19
7	合计	212,776,837.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,218,356.20	1.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	129,858,854.85	63.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,432,006.16	7.04
F	批发和零售业	20,708,415.69	10.10
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	-	-
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	6,044,408.80	2.95
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	7,726,476.96	3.77
S	综合	-	-
	合计	181,988,518.66	88.76

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	300079	数码视讯	540,385	14,358,029.45	7.00
2	000423	东阿阿胶	282,495	11,415,622.95	5.57
3	600079	人福医药	330,000	10,705,200.00	5.22
4	601222	林洋电子	500,245	8,969,392.85	4.37
5	600703	三安光电	407,121	8,260,485.09	4.03
6	600518	康美药业	419,998	7,866,562.54	3.84
7	300196	长海股份	339,910	7,800,934.50	3.80
8	601098	中南传媒	555,063	7,726,476.96	3.77
9	002322	理工监测	580,000	7,656,000.00	3.73
10	002586	围海股份	649,941	7,643,306.16	3.73

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,955.20
2	应收证券清算款	14,634,492.23
3	应收股利	-
4	应收利息	5,971.21
5	应收申购款	605,704.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,293,122.76

5.10.4 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换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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在流通受限情况。

§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	236,843,074.30
本报告期基金总申购份额	3,095,307.36
减:本报告期基金总赎回份额	47,302,892.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	192,635,488.84

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公司管理基金情况

诺德基金管理有限公司本季度末申购或赎回本基金。

§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中小盘股票型证券投资基金募集的批复。

2、《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》。

3、《诺德中小盘股票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、诺德中小盘股票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,E-mail:service@lordabbettchina.com。

诺德基金管理有限公司
二〇一三年十月二十四日

诺德周期策略股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	诺德周期策略股票
基金主代码	570008
交易代码	570008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月21日
报告期末基金份额总额	57,589,330.59份
投资目标	基于经济周期和政策导向的关系研究,采取“自上而下”的宏观经济研究与“自下而上”的微观个股选择相结合的方法进行主动型资产配置、行业配置和股票选择,追求资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过宏观、行业、个股等三重纬度的基本面研究,对当前经济周期演变形势下的行业前景和公司盈利进行详细跟踪和评判,并由此挖掘出具备核心竞争力、有能力把握行业成长机遇的优质个股,最终在充分考虑风险因素的基础上,构建投资组合进行集中投资,力争抵御通货膨胀或通货紧缩,获取超额收益。
业绩比较基准	沪深300 指数×80%+金融同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,是证券投资基金中的较高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	7,969,656.19
2.本期利润	12,166,467.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.2308
4.期末基金资产净值	66,523,204.32
5.期末基金份额净值	1.155

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

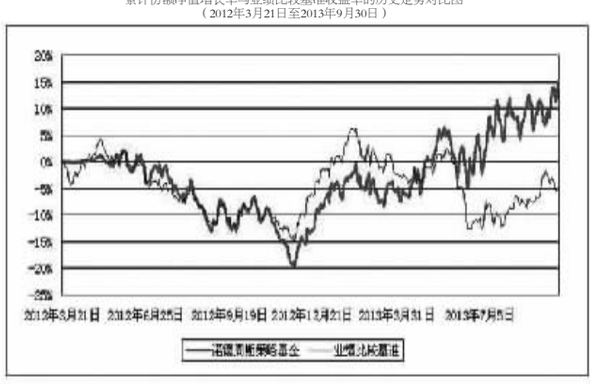
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年7月1日至2013年9月30日	18.34%	1.92%	7.66%	1.15%	10.68%	0.77%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

诺德周期策略股票型证券投资基金

累计份额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3月21日至2013年9月30日)



注:诺德周期策略股票型证券投资基金成立于2012年3月21日,图示时间段为2012年3月21日至2013年9月30日。

本基金建仓期为2012年3月21日至2012年9月20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		
陈国光	本基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-4-24	-	11	2002年7月至2006年5月,任职于清华兴业投资管理有限公司,从事投资研究工作;2006年8月起任职于诺德基金管理有限公司投资研究部,历任研究员、高级研究员、基金经理助理等职务。陈国光先生具有基金从业资格。
胡志伟	本基金、诺德价值优势基金、诺德成长优势基金基金经理、投资总监	2012-3-21	-	16	南京大学经济学硕士,1997年7月至2005年7月在江苏证券有限公司(现“华泰证券股份有限公司”)、亚洲控股有限责任公司工作,先后担任投资银行业务经理、行业研究员、证券投资高级经理等职务。2005年8月加入诺德基金管理有限公司,先后担任了公司投资研究部行业研究员、投资研究部经理等职务。胡志伟先生现任公司投资总监,具有基金从业资格,并持有CFA证书。

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,