诺德成长优势股票型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

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:二〇一五年三月二十六日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺德成长优势股票
场内简称	/
基金主代码	570005
交易代码	570005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月22日
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
报告期末基金份额总额	40,422,449.45份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注具备高成长潜力的行业和个股,通过投资于具备充分成长空间的行业和拥有持续竞争优势的企业,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,为基金份额持有人创造风险收益比合理、超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金本着成长投资的理念,在构建投资组合时着重寻找成长性行业中的优势企业。本基金设计了"成长行业投资吸引力"模型,从"成长特性"和"安全边际"两个角度评估行业投资价值,通过定性和定量的指标体系以及管理层访谈、实地调研等方式对公司进入深入研究,评估企业的投资价值。本着"成长行业"和"优势企业"的两个选股维度,对最具吸引力的行业和个股进行更加深入的研究,找到最终投资标的,进行超额配置,完成投资组合的构建。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×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均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,也高于价值型股票基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张欣	田青
	联系电话	021-68879999	010-67595003
	电子邮箱	alan.chang@lordabbettchina.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0009	010-67595096
传真		021-68877727	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	17,742,756.80	11,921,868.68	-8,586,626.96
本期利润	18,892,360.19	9,602,902.22	4,958,962.71
加权平均基金份额本期利润	0.3482	0.1355	0.0645
本期基金份额净值增长率	34.73%	14.01%	7.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.4468	0.0741	-0.0580
期末基金资产净值	58,483,324.70	68,547,695.65	69,996,329.37
期末基金份额净值	1.447	1.074	0.942

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2009年9月22日。

3.2 基金净值表现

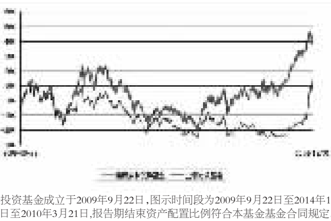
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	9.54%	1.10%	34.58%	1.32%	-25.04%	-0.22%
过去六个月	28.62%	0.92%	49.01%	1.06%	-20.39%	-0.14%
过去一年	34.73%	1.05%	41.16%	0.97%	-6.43%	0.08%
过去三年	64.62%	1.22%	43.09%	1.04%	21.53%	0.18%
过去五年	29.43%	1.27%	4.46%	1.09%	24.97%	0.18%
自基金合同生效起至今	44.70%	1.28%	14.27%	1.11%	30.43%	0.17%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数*80%+上证国债指数*20%。

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

诺德成长优势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的历史走势对比图
(2009年9月22日至2014年12月31日)



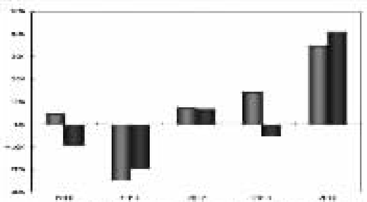
注:诺德成长优势股票型证券投资基金成立于2009年9月22日,图示时间段为2009年9月22日至2014年12月31日。

本基金建仓期为2009年9月22日至2010年3月21日,报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准为沪深300指数*80%+上证国债指数*20%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺德成长优势股票型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本图为基金过2010年至2014年12月31日的基金净值增长率与业绩基准收益率比较。本基金的业绩比较基准为沪深300指数*80%+上证国债指数*20%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2009 年9月22 日,自基金合同生效以来未发生利润分配事项。

§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、诺德中小盘股票型证券投资基金基金经理、研究副总监	2014-11-18	-	10	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。
胡志伟	本基金基金经理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、投资总监	2009-09-24	2014-11-18	17	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、投资总监等职务,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。

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,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为保证各类受托投资资金的安全,保证本公司各项资产管理业务的正常运行,维护投资者的合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定,基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》,确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合,严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,其规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体的控制措施包括:

一、实施信息隔离制度:公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;

二、公平分享研究分析报告:所有研究报告均在公司内网平台上发布,但是禁止在其他公开渠道发布,各组合经理同步获取研究分析报告资料;

三、严格控制同日反向交易:原则上禁止不同投资组合之间的同日反向交易,确实由于投资组合的投资决策或流动性等需要而发生的同日反向交易,相关投资组合经理应向投资决策委员会提供决策依据并留存记录备案;

四、公平执行交易指令:(1)交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时,除需经过公平性审核的例外指令外,必须开启系统的公平交易开关;(2)不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易,对于需要分配交易量的交易,应当填写《公平交易审批表》,按比例分配的原则实施分配,保证不同投资组合获得公平的交易机会;(3)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室应按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易,应当实施公平性审核,填写《公平交易审批表》,报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

五、实施事前审核和事后稽核:公司风险管理部门根据市场公认的第三方信息对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行事前审查,对公平交易的不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行事中监控,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行事后分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。本公司在2014年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经T检验分析和贡献率分析,本投资组合与其他投资组合日内、3日内、5日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况,也未发现其他存在利益输送的情况。

4.3.3 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,本基金与其它组合之间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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2014年下半年A股市场异军突起,尤其是4季度金融地产等大盘蓝筹在国企改革、沪港通、"一带一路"等政策主题的推动下出现持续上涨,A股市场久违的赚钱效应也吸引了大量增量资金的进入,以券商为首的金融板块股价成为市场上涨的中流砥柱,进一步烘托出市场的人气暴涨。

本基金在2014年一直采取稳定仓位、均衡配置、精选个股的总体策略,整体仓位维持在八成左右,行业配置上低估值蓝筹和小盘成长股各占半壁江山。上半年,在上证指数维持箱体震荡之时,本基金积极利用成长股回调机会增持部分成长确定、估值合理的个股,取得了较好的投资收益;但下半年,在4季度低估值蓝筹引领市场持续上涨的过程中,上述总体策略在仓位配置上略有吃亏,均衡配置也一定程度上了降低了组合的上涨弹性,因此4季度本基金投资业绩的相对排名下滑较为明显。全年综合来看,本基金投资业绩小幅跑输比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.447元,累计净值为1.447 元。本报告期份额净值增长率为34.73%,同期业绩比较基准增长率为41.16%。

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 年上半年,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。我们倾向于认为制约2015年A股市场继续走强的关键变量在于通缩周期是否真的来临,而支撑2015年A股市场焕发活力的核心依然在于政策变量。

2015年,本基金将维持稳定仓位、均衡配置、精选个股的长期策略。在经济结构调整和新一轮改革开放的进程中,我们依然将低估值蓝筹行业的配置焦点集中在与政策主题密切相关的金融、建筑、资源等行业,而将成长性行业的配置焦点仍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、体育、教育以及高端装备等行业。在此基础上,我们将力争通过均衡配置,并精选个股的方式,以达到相对稳定的投资回报,最终战胜比较基准。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2015)第20651号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:诺德成长优势股票型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:	–	–
银行存款	10,204,235.31	4,392,928.62
结算备付金	221,536.37	575,834.24
存出保证金	31,526.75	43,487.81
交易性金融资产	48,676,510.45	60,516,484.30
其中:股票投资	48,676,510.45	60,516,484.30
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	3,300,000.00
应收证券清算款	–	669,051.93
应收利息	1,935.09	1,854.58
应收股利	–	–
应收申购款	6,424.97	7,115.70
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	59,142,168.94	69,506,757.18
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:	–	–
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	203.00	275,117.96
应付赎回款	145,538.97	119,819.79
应付管理人报酬	83,191.83	87,737.09
应付托管费	13,865.31	14,622.85
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	55,907.68	101,758.22
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	360,137.45	360,005.62
负债合计	658,844.24	959,061.53
所有者权益:	–	–
实收基金	40,422,449.45	63,817,096.35
未分配利润	18,060,875.25	4,730,599.30
所有者权益合计	58,483,324.70	68,547,695.65
负债和所有者权益总计	59,142,168.94	69,506,757.18

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.447元,基金份额总额40,422,449.45份。

7.2 利润表

会计主体:诺德成长优势股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	21,127,837.59	12,077,248.78
1.利息收入	214,415.61	203,422.74
其中:存款利息收入	65,440.11	50,452.12
债券利息收入	–	3,478.33
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	148,975.50	149,492.29
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,748,555.11	14,181,979.29
其中:股票投资收益	19,256,548.65	13,514,461.42
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	-945.00
资产支持投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	492,006.46	668,462.87
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,149,603.39	-2,318,966.46
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	15,263.48	10,813.21
减:二、费用	2,235,477.40	2,474,346.56
1.管理人报酬	957,680.29	1,082,910.85
2.托管费	159,613.49	180,485.15
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	738,001.80	832,123.19
5.利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	380,181.82	378,827.37
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,892,360.19	9,602,902.22
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,892,360.19	9,602,902.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺德成长优势股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	63,817,096.35	4,730,599.30	68,547,695.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	18,892,360.19	18,892,360.19
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)	-23,394,646.90	-5,562,084.24	-28,956,731.14
其中:1.基金申购款	20,687,884.82	5,120,043.29	25,807,928.11
2.基金赎回款	-44,082,531.72	-10,682,127.53	-54,764,659.25
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)	40,422,449.45	18,060,875.25	58,483,324.70
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	74,306,194.79	-4,309,865.42	69,996,329.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	9,602,902.22	9,602,902.22
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)	-10,489,098.44	-562,437.50	-11,051,535.94
其中:1.基金申购款	9,157,325.66	149,020.16	9,306,345.82
2.基金赎回款	-19,646,424.10	-711,457.66	-20,357,881.76
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)	63,817,096.35	4,730,599.30	68,547,695.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德成长优势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[2009]471号《关于核准诺德成长优势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《诺德成长优势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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集514,582,006.70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(2009)第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德成长优势股票型证券投资基金基金合同》于2009年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为514,662,125.54份基金份额,其中认购资金利息折合80,118.84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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德成长优势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:股票资产占基金资产的60%-95%;债券及其他货币市场工具占基金资产的0%-35%;保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:80% X 沪深300 指数+20% X 上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于2015年3月25日批准报出。

7.4.2 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》、《诺德成长优势股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报 表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,应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。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

7.4.7 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司("长江证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	–	–	23,113,193.39	4.27%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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 2013年1月1日至2013年12月31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	21,041.99	4.28%	–	–

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	957,680.29	1,082,910.85
其中:支付销售机构的客户维护费	204,132.50	251,826.58

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1.5%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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	159,613.49	180,485.15

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.74%	15.67%

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,204,235.31	53,856.94	4,392,928.62	39,879.51

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002531	天顺风能	2014-12-17	重大资产重组	15.28	2015-01-26	15.48	100,000.00	1,340,776.00	1,528,000.00	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未从事债券正回购交易,无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为47,148,510.45元,属于第二层次的余额为1,528,000.00元,无第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次59,967,484.30元,第二层次549,000.00元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	48,676,510.45	82.30
	其中:股票	48,676,510.45	82.30
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	10,425,771.68	17.63
7	其他各项资产	39,886.81	0.07
8	合计	59,142,168.94	100.00

8.2 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	613,200.00	1.05
B	采矿业	–	–
C	制造业	34,962,160.14	59.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	713,500.00	1.22
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,700.00	0.47
J	金融业	8,716,540.00	14.90
K	房地产业	2,848,035.31	4.87
L	租赁和商务服务业	547,375.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	48,676,510.45	83.23

8.3 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	601601	中国太保	81,400	2,629,220.00	4.50
2	601567	三星电气	140,000	2,623,600.00	4.49
3	000728	国元证券	76,000	2,368,920.00	4.05
4	600252	中恒集团	133,971	2,191,765.56	3.75
5	600499	科达洁能	109,950	2,029,677.00	3.47
6	600837	海通证券	80,000	1,924,800.00	3.29
7	600079	人福医药	70,000	1,795,500.00	3.07
8	601555	东吴证券	80,000	1,793,600.00	3.07
9	300039	上海凯宝	130,000	1,648,400.00	2.82
10	002146	荣盛发展	100,000	1,587,000.00	2.71

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002358	森源电气	5,209,231.00	7.60
2	600340	华夏幸福	4,774,866.16	6.97
3	601318	中国平安	4,275,634.79	6.24
4	600837	海通证券	4,179,586.00	6.10
5	601601	中国太保	4,104,722.89	5.99
6	600252	中恒集团	3,956,570.44	5.77
7	300265	通光线缆	3,738,351.41	5.45
8	300070	碧水源	3,621,975.68	5.28
9	002642	荣之联	3,619,426.15	5.28
10	002108	沧州明珠	3,237,284.33	4.72
11	600309	万华化学	3,129,024.47	4.56
12	300034	钢研高纳	3,090,508.50	4.51
13	600312	平高电气	3,068,281.00	4.48
14	601222	林洋电子	3,010,181.27	4.39
15	000728	国元证券	2,968,691.60	4.33
16	002516	江苏旷达	2,958,423.80	4.32
17	002531	天顺风能	2,835,833.95	4.14
18	601099	太平洋	2,760,196.00	4.03
19	601992	金隅股份	2,735,671.00	3.99
20	600999	招商证券	2,706,787.00	3.95
21	000001	平安银行	2,643,034.66	3.86
22	601567	三星电气	2,607,976.86	3.80
23	601169	北京银行	2,592,175.00	3.78
24	300072	三聚环保	2,481,185.30	3.62
25	600794	保税科技	2,463,909.91	3.59
26	300133	华策影视	2,434,814.79	3.55
27	600499	科达洁能	2,410,568.50	3.52
28	600584	长电科技	2,379,270.76	3.47
29	600801	华新水泥	2,352,303.00	3.43
30	300183	东软载波	2,340,149.28	3.41
31	002111	威海广泰	2,309,331.04	3.37
32	600522	中天科技	2,254,032.64	3.29
33	600728	佳都科技	2,237,106.18	3.26
34	002477	雏鹰农牧	2,232,240.00	3.26
35	002191	劲嘉股份	2,154,649.97	3.14
36	002179	中航光电	2,148,798.00	3.13
37	000789	万年青	2,117,360.00	3.09
38	600038	中直股份	2,113,918.97	3.08
39	600405	动力源	2,067,902.00	3.02
40	002271	东方雨虹	2,052,805.05	2.99
41	002527	新时达	2,041,796.90	2.98
42	002353	杰瑞股份	2,002,423.01	2.92
43	000006	深振业A	1,995,730.00	2.91
44	600585	海螺水泥	1,851,831.00	2.70
45	000839	中信国安	1,822,838.00	2.66
46	601555	东吴证券	1,811,900.00	2.64
47	002073	软控股份	1,804,323.38	2.63
48	300338	开元仪器	1,780,124.20	2.60
49	001696	宗申动力	1,732,883.36	2.53
50	000732	泰禾集团	1,676,535.52	2.45
51	000513	丽珠集团	1,662,216.81	2.42
52	000997	新 大 陆	1,661,851.00	2.42
53	002318	久立特材	1,645,043.00	2.40
54	300370	安控科技	1,644,988.00	2.40
55	002029	七 匹 狼	1,638,237.82	2.39
56	000049	德赛电池	1,634,800.00	2.38
57	000553	沙隆达A	1,619,679.30	2.36
58	600426	华鲁恒升	1,604,364.64	2.34
59	600535	天士力	1,602,504.52	2.34
60	000625	长安汽车	1,589,470.00	2.32
61	000901	航天科技	1,579,242.53	2.30
62	000797	中国武夷	1,557,571.48	2.27
63	600881	亚泰集团	1,511,354.00	2.20
64	002500	山西证券	1,501,462.50	2.19
65	600016	民生银行	1,478,000.00	2.16
66	600703	三安光电	1,432,591.39	2.09
67	002698	博实股份	1,421,430.99	2.07
68	600104	上汽集团	1,376,552.00	2.01

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。

8.4.2 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	002358	森源电气	6,372,223.70	9.30
2	600585	海螺水泥	6,288,053.00	9.17
3	600837	海通证券	5,962,472.00	8.70
4	600340	华夏幸福	5,743,086.92	8.38
5	601318	中国平安	5,593,354.72	8.16
6	002179	中航光电	4,829,903.48	7.05
7	600801	华新水泥	4,255,012.60	6.21
8	002642	荣之联	4,191,975.61	6.12
9	002111	威海广泰	4,109,796.04	6.00
10	300265	通光线缆	3,999,246.74	5.83
11	600728	佳都科技	3,975,090.70	5.80
12	002271	东方雨虹	3,831,969.41	5.59
13	000789	万年青	3,806,731.39	5.55
14	002516	江苏旷达	3,802,987.54	5.55
15	002108	沧州明珠	3,610,423.19	5.27
16	300070	碧水源	3,447,258.72	5.03
17	002023	海特高新	3,430,008.11	5.00
18	300034	钢研高纳	3,360,317.36	4.90
19	002630	华西能源	3,291,810.80	4.80
20	601601	中国太保	3,136,911.63	4.58
21	300039	上海凯宝	3,043,592.36	4.44
22	002527	新时达	2,886,369.00	4.21
23	300133	华策影视	2,816,168.92	4.11
24	000001	平安银行	2,717,780.77	3.96
25	000816	江淮动力	2,711,395.79	3.96
26	601099	太平洋	2,679,758.92	3.91
27	600405	动力源	2,660,842.01	3.88
28	601169	北京银行	2,621,713.00	3.82
29	600794	保税科技	2,609,835.20	3.81
30	300183	东软载波	2,594,751.10	3.79
31	600038	中直股份	2,527,997.72	3.69
32	600522	中天科技	2,524,218.09	3.68
33	600999	招商证券	2,500,917.00	3.65
34	600426	华鲁恒升	2,479,003.43	3.62
35	600584	长电科技	2,445,801.07	3.57
36	000024	招商地产	2,395,164.21	3.49
37	600309	万华化学	2,382,724.99	3.48
38	300072	三聚环保	2,286,622.82	3.34
39	600535	天士力	2,281,361.42	3.33
40	000728	国元证券	2,273,063.25	3.32
41	601555	东吴证券	2,272,013.63	3.31
42	000860	顺鑫农业	2,251,029.91	3.28
43	002073	软控股份	2,208,471.00	3.22
44	601222	林洋电子	2,166,064.82	3.16
45	002191	劲嘉股份	2,153,751.46	3.14
46	300196	长海股份	2,152,241.00	3.14
47	600252	中恒集团	2,097,526.68	3.06
48	600893	中航动力	2,053,293.05	3.00
49	000006	深振业A	1,989,458.81	2.90
50	000732	泰禾集团	1,956,733.00	2.85
51	001696	宗申动力	1,938,099.29	2.83
52	300074	华平股份	1,928,911.20	2.81
53	601117	中国化学	1,909,375.00	2.79
54	000839	中信国安	1,884,478.76	2.75
55	300370	安控科技	1,871,001.00	2.73
56	002324	普利特	1,828,927.00	2.67
57	600312	平高电气	1,805,048.96	2.63
58	000513	丽珠集团	1,801,404.00	2.63
59	601992	金隅股份	1,749,206.33	2.55
60	000049	德赛电池	1,744,455.20	2.54
61	002318	久立特材	1,740,807.00	2.54
62	000997	新 大 陆	1,736,170.00	2.53
63	002465	海格通信	1,727,658.50	2.52
64	002477	雏鹰农牧	1,712,986.00	2.50
65	300338	开元仪器	1,652,041.47	2.41
66	002500	山西证券	1,585,937.17	2.31
67	000797	中国武夷	1,584,021.00	2.31
68	601965	中国汽研	1,574,503.84	2.30
69	600881	亚泰集团	1,569,123.00	2.29
70	600016	民生银行	1,520,000.00	2.22
71	000625	长安汽车	1,484,068.00	2.17
72	002029	七 匹 狼	1,480,031.60	2.16
73	002698	博实股份	1,457,496.00	2.13
74	000901	航天科技	1,432,688.58	2.09
75	300263	隆华节能	1,392,382.82	2.03
76	002091	江苏国泰	1,375,978.99	2.01
77	002531	天顺风能	1,372,116.84	2.00

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。8.4.3 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	220,530,073.78
卖出股票的收入(成交)总额	252,776,199.67

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。

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3 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	31,526.75
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,935.09
5	应收申购款	6,424.97
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	39,886.81

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
1,311	30,833.29	18,185,818.65	44.99%	22,236,630.80	55.01%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金份额。

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年9月22日)基金份额总额	514,662,125.54
本报告期期初基金份额总额	63,817,096.35
本报告期基金总申购份额	20,687,884.82
减:本报告期基金总赎回份额	44,082,531.72
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	40,422,449.45

注:总申购份额包含转换入份额;总赎回份额包含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

(1)本报告期内,本基金管理人高级管理人员无重大人事变动。

(2)本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内继续聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)担任本基金2014年度的基金审计机构,报告期内应支付给会计师事务所的报酬人民币6万元,目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供连续6年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
西部证券	2	–	–	–	–	–
中投证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
联合证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	1	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
财富证券	2	–	–	–	–	–
申银万国	1	–	–	–	–	–
山西证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	2	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
第一创业证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
齐鲁证券	3	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
湘财证券	1	–	–	–	–	–
华西证券	2	–	–	–	–	–
银泰证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	2	129,867,664.97	27.45%	118,231.38	27.45%	–
国金证券	1	97,898,683.27	20.69%	89,127.45	20.69%	–
平安证券	2	48,226,585.01	10.19%	43,905.15	10.19%	–
宏源证券	1	44,285,386.40	9.36%	40,317.68	9.36%	–
光大证券	2	43,884,796.13	9.27%	39,952.62	9.27%	–
中信建投	1	41,038,449.74	8.67%	37,360.73	8.67%	–
广发证券	1	37,757,620.80	7.98%	34,374.71	7.98%	–
东方证券	1	16,454,369.40	3.48%	14,979.99	3.48%	–
海通证券	1	8,997,097.01	1.90%	8,190.95	1.90%	–
东兴证券	1	4,749,340.72	1.00%	4,323.69	1.00%	–

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。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内基金管理人根据工作需要,新租用如下基金专用交易单元:光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、财富证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、华创证券股份有限公司;退租如下基金专用交易单元:长江证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、江南证券有限责任公司。

11.7.2 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
平安证券	–	–	308,300,000.00	28.03%	–	–
宏源证券	–	–	142,500,000.00	12.96%	–	–
光大证券	–	–	274,900,000.00	25.00%	–	–
中信建投	–	–	198,400,000.00	18.04%	–	–
海通证券	–	–	85,100,000.00	7.74%	–	–
东兴证券	–	–	90,500,000.00	8.23%	–	–

§12 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
二〇一五年三月二十六日