诺德优选30股票型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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:二〇一四年八月二十六日

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2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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

基金名称	诺德优选30股票型证券投资基金
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	415,598,605.89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,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	张侠	王永民
	联系电话	021-68879999	010-66594896
	电子邮箱	alan.chang@lordabbettchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68877727	010-66594942
注册地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨忆凤	田国立

2.4 信息披露方式

项目	(中国证券报)、(上海证券报)、(证券时报)	
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com	
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所	

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺德基金管理有限公司	上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室

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(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	10,229,311.03
本期利润	3,421,130.88
加权平均基金份额本期利润	0.0078
本期加权平均净值利润率	0.94%
本期基金份额净值增长率	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2014年6月30日)**
期末可供分配利润	-67,273,840.69
期末可供分配基金份额利润	-0.1619
期末基金资产净值	348,988,452.80
期末基金份额净值	0.840
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2014年6月30日)**
基金份额累计净值增长率	-16.00%

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外费用,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	5.79%	1.05%	0.34%	0.62%	5.45%	0.43%
过去三个月	3.19%	1.14%	0.77%	0.70%	2.42%	0.44%
过去六个月	0.60%	1.39%	-5.54%	0.83%	6.14%	0.56%
过去一年	11.70%	1.44%	-0.89%	0.94%	12.59%	0.50%
过去三年	-15.66%	1.33%	-22.77%	1.04%	7.11%	0.29%
自基金合同生效起至今	-16.00%	1.30%	-24.41%	1.03%	8.41%	0.27%

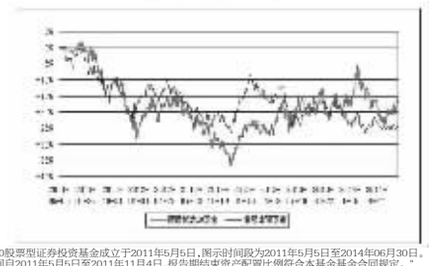
注:业绩比较基准=沪深300指数*80%+同业存款利率*20%

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2014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2014年06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金字[2006]188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、诺华控股有限公司,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、诺德保证30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		
李圣春	本基金基金经理	2013-05-28	-	7	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、上海瑞品投资管理有限公司,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 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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

1季度,欠佳的经济数据,导致市场情绪悲观,大盘震荡下行。2季度,从年初开始下滑的经济数据逐步企稳,同时政府出手进行微刺激,市场的悲观情绪也随之转好,大盘整体呈震荡态势。今年前两个月,流动性较2013年年底好转,新年伊始风险偏好较高,加上又是业绩空窗期,代表新经济的创业板走出了与大盘截然相反的走势。但是,进入3月份,随着经济数据的逐步出炉,以及业绩披露和预告的验证,风格发生明显变化,大盘震荡盘整,创业板明显下跌。这种风格一直延续到5月中旬,才重新切换回成长风格,代表新兴成长的创业板和中小板出现明显反弹。

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。重点配置了医药、计算机、电气设备、机械设备和食品饮料。其中,电气设备主要配置在光伏、风电相关公司上,而机械设备主要是与环保相关的公司。期间,市场风格虽然有切换,但凭借"持续成长性"的投资风格和精选个股,本基金业绩表现良好,最终跑赢业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年06月30日,本基金份额净值为 0.840元,累计净值为0.840元。本报告期份额净值增长率为0.60%,同期业绩比较基准增长率为-5.54%。

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3季度,经济数据企稳,市场对经济预期相对稳定,政府的微刺激效应也将逐步显现,后续的预调微调也将使经济在合理的区间内运行。在稳增长的基础上促转型的大背景下,传统行业落后产能逐步淘汰,行业集中度将提高,盈利有所改观,但过程将很缓慢。代表未来方向的新兴行业占比将逐步上升,但受稳增长的制约,同样可能不快。在经济总体平稳运行、流动性适中的情形下,证券市场很难有良好表现,呈现震荡盘整态势可能性很大。而稳增长基础上的调结构、促转型,可能使市场会出现新兴行业主导的成长股结构性行情和传统蓝筹的估值恢复行情交替出现。不过,总体而言前者的表现机会可能更多。

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,还有解决环保根源问题的能源结构相关产业。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。

4.6 管理人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,定期评估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,完全履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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	54,202,399.26	26,108,815.32
结算备付金		243,403.38	2,058,709.38
存出保证金		158,368.69	151,566.44
交易性金融资产	6.4.7.2	300,056,914.56	353,625,666.95
其中:股票投资		300,056,914.56	353,625,666.95
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	11,774,495.05
应收利息	6.4.7.5	7,021.73	7,310.92
应收股利		-	-
应收申购款		4,948.05	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		354,673,055.67	393,727,156.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,397,011.31	-
应付赎回款		414,282.11	1,627,334.84
应付管理人报酬		418,316.66	495,415.56
应付托管费		69,719.43	82,569.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	206,715.80	505,547.77
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	178,557.56	360,000.00
负债合计		5,684,602.87	3,070,867.42
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	415,598,605.89	468,081,787.61
未分配利润	6.4.7.10	-66,610,153.09	-77,425,498.09
所有者权益合计		348,988,452.80	390,656,289.52
负债和所有者权益总计		354,673,055.67	393,727,156.94

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.840元,基金份额总额415,598,605.89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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		8,299,512.03	22,377,937.37
1.利息收入		211,442.88	1,095,162.28
其中:存款利息收入	6.4.7.11	137,187.77	99,120.39
债券利息收入		-	317,680.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		74,255.11	678,360.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		14,895,576.23	47,635,420.17
其中:股票投资收益	6.4.7.12	12,923,814.51	45,094,644.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	43,724.05
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,971,761.72	2,497,051.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-6,808,180.15	-26,377,218.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	673.07	24,573.80
减:二、费用		4,878,381.15	5,568,617.64
1.管理人报酬		2,724,686.20	3,479,331.60
2.托管费		454,114.34	579,888.56
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	1,511,597.99	1,317,093.69
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	187,982.62	192,303.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,421,130.88	16,809,319.73
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		3,421,130.88	16,809,319.73

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	468,081,787.61	-77,425,498.09	390,656,289.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,421,130.88	3,421,130.88
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)	-52,483,181.72	7,394,214.12	-45,088,967.60
其中:1.基金申购款	1,999,153.77	-243,018.84	1,756,134.93
2.基金赎回款	-54,482,335.49	7,637,232.96	-46,845,102.53
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)	415,598,605.89	-66,610,153.09	348,988,452.80

项目	上年度可比期间 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)	652,938,080.43	-178,061,577.39	474,876,503.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,809,319.73	16,809,319.73
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)	-74,771,034.15	17,663,012.65	-57,108,021.50
其中:1.基金申购款	954,668.00	-219,426.85	735,241.15
2.基金赎回款	-75,725,702.15	17,882,439.50	-57,843,262.65
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)	578,167,046.28	-143,589,245.01	434,577,801.27

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:股票投资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>》、《中国证券基金投资业协会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》和中国证监会公布的有关规定及在计算基金份额净值、编制财务会计报表方面所采用的会计政策、会计估计等方面,本报告期内,本基金管理人在所执行的会计政策、会计估计等方面均无重大变更。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014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 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

本报告期会计提所采用的会计政策、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应税范围,不应收营业税。

(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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	54,202,399.26
定期存款	-
其他存款	-
合计	54,202,399.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2014年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		289,406,227.75	300,056,914.56	10,650,686.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		289,406,227.75	300,056,914.56	10,650,686.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未从事买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	6,842.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	108.24
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	71.30
合计	7,021.73

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	206,715.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	206,715.80

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	39.07
其他应付款	-
预提费用	178,518.49
合计	178,557.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	468,081,787.61	468,081,787.61
本期申购	1,999,153.77	1,999,153.77
本期赎回(以"-"号填列)	-54,482,335.49	-54,482,335.49
本期末	415,598,605.89	415,598,605.89

注:申购含转入份额;赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-86,052,410.88	8,626,912.79	-77,425,498.09
本期利润	10,229,311.03	-6,808,180.15	3,421,130.88
本期基金份额交易产生的变动数	8,549,259.16	-1,155,045.04	7,394,214.12
其中:基金申购款	-315,684.99	72,666.15	-243,018.84
基金赎回款	8,864,944.15	-1,227,711.19	7,637,232.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-67,273,840.69	663,687.60	-66,610,153.09

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	125,323.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,823.86
其他	1,039.94
合计	137,187.77

6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	515,797,959.31
减:卖出股票成本总额	502,874,144.80
买卖股票差价收入	12,923,814.51

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金未参与贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,971,761.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,971,761.72

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	-6,808,180.15
——股票投资	-6,808,180.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-6,808,180.15

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	608.04
转换费收入	65.03
合计	673.07

注:1. 本基金的赎回费率按持有期间递减,赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费用由申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成,其中转出基金的赎回费总额的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,511,597.99
银行间市场交易费用	-
合计	1,511,597.99

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行费用	4,964.13
银行间债券帐户维护费	4,500.00
合计	187,982.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,724,686.20	3,479,331.60
其中:支付销售机构的客户维护费	1,287,584.03	1,650,519.32

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	454,114.34	579,888.56

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期末,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	54,202,399.26	125,323