诺德主题灵活配置混合型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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:二〇一一年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2011年3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2010年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	诺德灵活配置混合
基金主代码	571002
交易代码	571002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月5日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,836,554.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注中国在经济崛起过程中带来的结构性变化,及时把握宏观投资趋势,通过准确的主题配置和精选个股,追求资产长期稳定的增值,在有效控制风险的前提下为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金深刻分析影响国家经济发展和企业盈利的关键和趋势性因素,及时把握中国经济崛起过程中主题演变带来的投资机会,强调对上市公司基本面的深入研究,精心挑选主题演变中的优势企业。充分挖掘企业的投资价值基础上,确保一定的安全边际,进行中长期投资。 本基金重视自上而下的主题发掘,通过对宏观经济中制度性、结构性或周期性发展趋势的研究,把握中国经济崛起的产业变迁,从而了解中国产业演进的趋势,寻找到中长期发展趋势良好的企业。本基金管理人认为:和谐社会、自主创新、产业升级、消费升级将是与中国经济崛起相关度最大的四大主题,将这四大主题贯彻到研究中,以此确立投资的重点领域。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为偏股型的混合型基金,风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张欣	尹东
	联系电话	021-68879999	010-67595003
	电子邮箱	xin.zhang@lordabbettchina.com	yindong@ccb.com
客户服务电话		400-888-0009	010-67595096
传真		021-68877727	010-66275853
注册地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		李格平	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》及《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金年度报告备置地点	本基金年度报告原件置于陆家嘴环路1233号汇亚大厦12楼基金管理人办公场所

§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	2010年	2009年	2008年11月5日（基金合同生效日）至2008年12月31日
本期已实现收益	7,994,349.15	12,589,619.86	368,126.42
本期利润	5,911,270.35	16,088,587.07	565,587.42
加权平均基金份额本期利润	0.0819	0.2638	0.0035
本期加权平均净值利润率	6.84%	23.76%	0.35%
本期基金份额净值增长率	7.06%	24.17%	0.54%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配利润	17,444,835.16	20,624,476.14	260,723.45
期末可供分配基金份额利润	0.3365	0.2294	0.0030
期末基金资产净值	69,281,390.07	112,210,246.25	88,832,430.47
期末基金份额净值	1.3365	1.2484	1.0054
3.1.3 累计期末指标	2010年末	2009年末	2008年末
基金份额累计净值增长率	33.65%	24.84%	0.54%

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2008年11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
过去三个月	4.59%	1.70%	4.00%	1.06%	0.59%	0.64%
过去六个月	25.95%	1.44%	13.33%	0.93%	12.62%	0.51%
过去一年	7.06%	1.33%	-5.83%	0.95%	12.89%	0.38%
自基金合同生效起至今	33.65%	1.41%	55.34%	1.17%	-21.69%	0.24%

注:业绩比较基准=沪深300指数＊60%+上证国债指数＊40%

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

诺德主题灵活配置混合型证券投资基金
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
（2008年11月5日至2010年12月31日）

注:诺德主题灵活配置混合型证券投资基金成立于2008年11月5日,图示时间段为2008年11月5日至2010年12月31日。

本基金建仓期间自2008年11月5日至2009年5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。

3.2.3 自基金合同生效以来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

诺德主题灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

注:诺德主题灵活配置混合型证券投资基金成立于2008年11月5日,图示2008年度数据为2008年11月5日至2008年12月31日,合同生效当年净值增长率与业绩比较基准收益率按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2008年11月5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、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,公司管理了五只开放式基金,分别为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。

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		
戴奇雷	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	2008-11-05	2010-02-24	8年	华中理工大学理学硕士,中欧国际工商学院MBA,曾先后担任上海融昌资产管理公司研究总监助理、广州金骏资产管理公司研究总监等职。2006年6月加入诺德基金管理有限公司,先后担任研究员、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理助理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺德基金管理有限公司投资研究部经理等职。戴奇雷先生具有特许金融分析师（CFA）资格。
张学东	本基金基金经理、诺德成长优势股票型证券投资基金基金经理	2009-02-22	2010-03-02	13年	北京第二外国语学院经济学学士,1998年4月至2007年6月在华夏基金管理有限公司工作,先后担任研究员、基金经理助理等职务。2007年7月加入诺德基金管理有限公司,先后担任诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理助理、诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺德成长优势股票型证券投资基金基金经理等职。
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、公司投资总监	2010-02-24	-	13年	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,担任公司投资总监、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理及诺德中小盘股票型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格。
朱红	本基金基金经理助理	2010-08-11	-	3年	大连理工大学工商管理硕士,2000年7月至2007年3月在中国建筑股份有限公司工作,先后担任项目部专业工程师、项目负责人、项目经理等职务,具有工程师职称和国家一级建造师资格。2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后担任投资研究部行业研究员、投资总监助理、新华优选分红基金基金经理助理等职务。2009年11月加入诺德基金管理有限公司,先后任投资研究部行业研究员、高级研究员,现为诺德主题灵活配置基金基金经理助理,具有基金从业资格。

注:经诺德基金管理有限公司总经理办公会议讨论通过,决定自2010年2月24日起聘任向朝勇先生担任本基金基金经理,戴奇雷先生不再担任本基金基金经理职务。上述事项于2010年2月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站公开披露。

2010年3月2日,经诺德基金管理有限公司总经理办公会议讨论通过,同意张学东先生因个人原因辞去所担任的本基金基金经理职务的请求,本基金由向朝勇先生单独管理。上述事项于2010年3月2日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站公开披露。

任职日期是指本公司总经理办公会作出决定之日;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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,不存在与诺德主题灵活配置型基金风格类似的投资组合,公司旗下另四只基金产品分别为价值股票型基金、成长股票型基金、债券型基金、中小盘股票型基金,五只基金的业绩不具有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

不存在不同投资组合之间的不公平交易情况。

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

2010年A股市场结构分化明显,上证综指及深成指全年均有一定下跌幅度,以银行地产为代表的受宏观调控影响较大的周期性蓝筹股全年领跌,而以中小板、创业板为代表的代表着新兴经济方向的中小市值股票走出持续牛市。市场走势主要反应了两个逻辑:一是在CPI持续攀升的大背景下,宏观经济政策逐步从刺激经济增长转向调控与收紧经济过热,因此影响了市场流动性;二是政府在方式上采用结构调控模式,制定并大力推进经济战略转型,新兴产业成为未来政府重点支持的产业方向,因此成为股市的热点,相关行业如电子元器件、医药生物和机械设备等全年涨幅居前。

2010年度本基金总体上采取了保持相对较高仓位,注重行业配置并精选个股的投资策略,根据政策调控的方向及行业景气度的确定性变化,适当减持了受调控影响较大的银行及地产等周期性行业,增配了受政策支持的医药、TMT及装备制造等行业,获取了较为理想的投资回报。但分看各季度,净值表现还是存在波动,尤其一季度相对配置了较多的周期性行业,在煤炭有色上损失较大,而二季度及四季度医药等小股票的大幅度下跌,对净值的冲击较大,但总体来说,由于投资方向明确,并精选个股,全年仍然取得较大的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2010年12月31日,基金份额净值为1.3365元,净值增长率为7.06%,同期业绩基准增长率为-5.83%,基金净值表现超越业绩基准。

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2011年,我们倾向于认为A股市场将有别于2010年,可能出现周期与成长相互交融的市场特征。这一特征将体现在两方面:一方面是周期性行业中有一定成长性且估值较低的行业,譬如工程机械、水泥、地产、银行等,可能重新获得市场关注;另一方面是非周期性行业中估值较高的行业,譬如TMT、新能源、日常消费等,一旦遇到业绩低于预期,可能出现股价的阶段性调整。

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

本基金成立于2008年11月5日,自基金合同生效以来未发生利润分配事项。依据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况,本基金2010年度暂不进行利润分配,符合有关法律法规和基金合同的规定。

§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,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,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有限公司审计,注册会计师汪棣、张鸿于2011年3月25日签字出具了普华永道中天审字（2011）第20604号标准无保留意见审计报告。投资者可以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:诺德主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,958,354.38	8,354,037.80
结算备付金		1,740,383.05	238,511.83
存出保证金		69,613.94	166,309.21
交易性金融资产	7.4.7.2	59,675,887.22	96,016,516.99
其中:股票投资		54,335,412.52	85,240,266.59
基金投资		-	-
债券投资		5,340,474.70	10,776,250.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		2,333,635.74	-
应收利息	7.4.7.5	83,410.35	126,626.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	140,231.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		72,861,284.68	115,042,233.87

负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,301,662.15	1,615,043.80
应付赎回款		38,062.37	523,326.74
应付管理人报酬		93,203.44	105,364.88
应付托管费		15,533.93	17,560.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	716,649.58	138,719.14
应交税费		4,686.80	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,096.34	431,972.26
负债合计		3,579,894.61	2,831,987.62
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	51,836,554.91	89,886,755.65
未分配利润	7.4.7.10	17,444,835.16	22,323,490.60
所有者权益合计		69,281,390.07	112,210,246.25
负债和所有者权益总计		72,861,284.68	115,042,233.87

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.3365元,基金份额总额51,836,554.91份。

7.2 利润表

会计主体:诺德主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		11,390,534.30	20,583,289.50
1.利息收入		349,698.00	355,655.80
其中:存款利息收入	7.4.7.11	73,989.92	84,960.03
债券利息收入		146,261.49	172,759.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,446.59	97,936.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,022,212.78	16,511,301.37
其中:股票投资收益	7.4.7.12	12,502,817.29	17,569,756.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	198,098.38	-1,386,119.83
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	321,297.11	327,664.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,083,078.80	3,498,967.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	101,702.32	217,365.12
减:二、费用		5,479,263.95	4,494,702.43
1.管理人报酬		1,305,770.54	1,020,216.37
2.托管费		217,628.45	170,035.99
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	3,520,014.42	2,853,492.33
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	435,850.54	450,957.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,911,270.35	16,088,587.07
减:所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,911,270.35	16,088,587.07

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:诺德主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	89,886,755.65	22,323,490.60	112,210,246.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,911,270.35	5,911,270.35
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）	-38,050,200.74	-10,789,925.79	-48,840,126.53
其中:1.基金申购款	32,182,368.29	8,761,910.25	40,944,278.54
2.基金赎回款	-70,232,569.03	-19,551,836.04	-89,784,405.07
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）	51,836,554.91	17,444,835.16	69,281,390.07
项目	**上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	88,358,283.70	474,146.77	88,832,430.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,088,587.07	16,088,587.07
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）	1,528,471.95	5,760,756.76	7,289,228.71
其中:1.基金申购款	158,244,278.08	23,719,488.27	181,963,766.35
2.基金赎回款	-156,715,806.13	-17,958,731.51	-174,674,537.64
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）	89,886,755.65	22,323,490.60	112,210,246.25

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德主题灵活配置混合型证券投资基金（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［2008］第785号《关于核准诺德主题灵活配置混合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《诺德主题灵活配置混合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238,700,715.81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（2008）第164号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2008年11月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为238,722,490.00份基金份额,其中认购资金利息折合21,774.19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《诺德主题灵活配置混合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、法规或中国证监会批准的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30%-80%;债券资产及其他金融工具占基金资产的20%-70%;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:60% ＊ 沪深300指数+40% ＊ 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2011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》、《诺德主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证券监督管理委员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2010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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值:

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

（1）重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告［2008］38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协（SAC）基金行业股票估值指数。

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

本报告期内本基金未发生会计政策变更事项。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

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［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。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	198,647,363.52	8.62%	322,392,734.68	17.04%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010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	163,556.31	8.52%	23,600.04	3.29%
关联方名称	**上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	267,421.23	16.87%	17,880.36	12.89%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,305,770.54	1,020,216.37
其中:支付销售机构的客户维护费	164,697.80	103,667.03

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 ＊ 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	217,628.45	170,035.99

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 ＊ 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	19,989,005.50	19,989,005.50
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	19,989,005.50	19,989,005.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	38.56%	22.24%

7.4.10.4.2 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

本报告期及上年度可比期间内,本基金其他关联方未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	4,958,354.38	50,368.98	8,354,037.80	56,177.76

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 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
600518	康美药业	2010-12-28	配股停牌	19.71	2011-01-06	17.29	14,614	251,093.00	288,041.94	-

注:本基金截至2010年12月31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。

7.4.12.3 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。

7.4.14 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）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。

（b）以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级:直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为59,387,845.28元,属于第二层级的余额为288,041.94元,无属于第三层级的余额（2009年12月31日:第一层级94,958,931.99元,第二层级1,057,585.00元,无第三层级）。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级（2009年度:同）。

（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	54,335,412.52	74.57
	其中:股票	54,335,412.52	74.57
2	固定收益投资	5,340,474.70	7.33
	其中:债券	5,340,474.70	7.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	4,000,000.00	5.49
	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	6,698,737.43	9.19
6	其他各项资产	2,486,660.03	3.41
7	合计	72,861,284.68	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	2,332,555.00	3.37
B	采掘业	2,528,109.56	3.65
C	制造业	32,323,134.32	46.65
C0	食品、饮料	3,126,514.15	4.51
C1	纺织、服装、皮毛	838,120.00	1.21
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,197,983.40	6.06
C5	电子	5,229,579.60	7.55
C6	金属、非金属	10,931,213.99	15.78
C7	机械、设备、仪表	3,773,365.74	5.45
C8	医药、生物制品	3,787,707.44	5.47
C99	其他制造业	438,650.00	0.63
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,149,000.00	1.66
E	建筑业	2,661,604.76	3.84
F	交通运输、仓储业	1,145,860.00	1.65
G	信息技术业	6,038,651.00	8.72
H	批发和零售贸易	328,700.00	0.47
I	金融、保险业	1,144,000.00	1.65
J	房地产业	3,584,347.88	5.17
K	社会服务业	1,099,450.00	1.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	54,335,412.52	78.43

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002146	荣盛发展	147,000	1,997,730.00	2.88
2	002138	顺络电子	63,000	1,745,100.00	2.52
3	002271	东方雨虹	44,000	1,733,600.00	2.50
4	002081	金螳螂	25,000	1,719,500.00	2.48
5	000960	锡业股份	52,159	1,705,599.30	2.46
6	002041	登海种业	25,000	1,647,750.00	2.38
7	600737	中粮屯河	98,000	1,553,300.00	2.24
8	002063	远光软件	47,100	1,464,810.00	2.11
9	002152	广电运通	26,000	1,413,880.00	2.04
10	002250	联化科技	33,682	1,380,962.00	1.99
11	600362	江西铜业	30,358	1,371,270.86	1.98
12	600458	时代新材	21,270	1,357,451.40	1.96
13	600594	益佰制药	66,945	1,319,485.95	1.90
14	600292	九龙电力	60,000	1,149,000.00	1.66
15	601169	北京银行	100,000	1,144,000.00	1.65
16	000401	冀东水泥	45,000	1,063,350.00	1.53
17	000933	神火股份	41,900	1,049,595.00	1.52
18	600585	海螺水泥	35,000	1,038,800.00	1.50
19	600176	中国玻纤	40,100	1,018,540.00	1.47
20	600809	山西汾酒	14,555	997,454.15	1.44
21	600079	人福医药	35,000	891,800.00	1.29
22	000877	天山股份	27,060	854,284.20	1.23
23	600188	兖州煤业	30,000	851,700.00	1.23
24	002313	日海通讯	14,640	844,728.00	1.22
25	000926	福星股份	62,531	842,917.88	1.22
26	002293	罗莱家纺	11,500	838,120.00	1.21
27	600516	方大炭素	58,663	821,868.63	1.19
28	600522	中天科技	25,000	771,250.00	1.11
29	002073	软控股份	28,246	753,885.74	1.09
30	300105	龙源技术	5,500	670,450.00	0.97
31	600428	中远航运	79,000	658,860.00	0.95
32	002055	得润电子	24,000	658,320.00	0.95
33	600502	安徽水利	47,000	634,500.00	0.92
34	002353	杰瑞股份	4,387	626,814.56	0.90
35	600668	尖峰集团	50,000	594,500.00	0.86
36	300086	康芝药业	7,400	591,482.00	0.85
37	000869	张裕A	6,000	575,760.00	0.83
38	002232	启明信息	25,000	574,750.00	0.83
39	600261	阳光照明	12,900	545,799.00	0.79
40	002065	东华软件	17,100	526,167.00	0.76
41	600993	马应龙	11,385	519,497.55	0.75
42	000598	兴蓉投资	25,000	515,750.00	0.74
43	002273	水晶光电	10,000	504,900.00	0.73
44	300092	科新机电	15,000	496,050.00	0.72
45	600029	南方航空	50,000	487,000.00	0.70
46	002008	大族激光	21,650	484,960.00	0.70
47	002230	科大讯飞	6,000	474,000.00	0.68
48	002474	榕基软件	9,000	445,500.00	0.64
49	000039	中集集团	19,000	436,810.00	0.63
50	300087	荃银高科	6,576	434,016.00	0.63
51	600823	世茂股份	30,000	405,300.00	0.59
52	300064	豫金刚石	10,000	368,100.00	0.53
53	600406	国电南瑞	5,000	360,300.00	0.52
54	600111	包钢稀土	5,000	357,200.00	0.52
55	002396	星网锐捷	8,300	350,343.00	0.51
56	300115	长盈精密	5,250	339,150.00	0.49
57	002244	滨江集团	30,000	338,400.00	0.49
58	000060	中金岭南	15,000	337,500.00	0.49
59	002436	兴森科技	5,000	335,550.00	0.48
60	000826	桑德环境	10,000	333,700.00	0.48
61	000963	华东医药	10,000	328,700.00	0.47
62	002449	国星光电	7,156	313,790.60	0.45
63	600970	中材国际	7,556	307,604.76	0.44
64	600518	康美药业	14,614	288,041.94	0.42
65	002398	建研集团	8,000	258,800.00	0.37
66	000998	隆平高科	7,700	250,789.00	0.36
67	300070	碧水源	2,000	250,000.00	0.36
68	000887	中鼎股份	10,200	248,880.00	0.36
69	002457	青龙管业	5,900	248,331.00	0.36
70	002261	拓维信息	5,700	226,803.00	0.33
71	300121	阳谷华泰	7,000	192,150.00	0.28
72	002290	禾盛新材	5,000	179,850.00	0.26
73	300122	智飞生物	5,000	177,400.00	0.26
74	002241	歌尔声学	3,000	164,010.00	0.24
75	600372	ST昌河	5,000	159,650.00	0.23
76	002123	荣信股份	3,000	142,500.00	0.21
77	300083	劲胜股份	3,000	138,000.00	0.20
78	300003	乐普医疗	5,000	136,950.00	0.20

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	601169	北京银行	31,017,400.60	27.64
2	601318	中国平安	22,108,009.21	19.70
3	601601	中国太保	17,822,168.20	15.88
4	601009	南京银行	17,521,380.66	15.61
5	000423	东阿阿胶	17,511,660.26	15.61
6	600594	益佰制药	15,040,916.02	13.40
7	000933	神火股份	14,269,099.96	12.72
8	601166	兴业银行	13,920,365.55	12.41
9	000858	五粮液	13,510,826.23	12.04
10	600188	兖州煤业	13,299,781.97	11.85
11	601699	潞安环能	12,728,571.76	11.34
12	600887	伊利股份	12,558,249.66	11.19
13	600348	国阳新能	11,734,610.94	10.46
14	002252	上海莱士	11,643,578.76	10.38
15	600261	阳光照明	11,517,473.40	10.26
16	600362	江西铜业	11,473,695.69	10.23
17	600000	浦发银行	10,949,809.67	9.76
18	002375	亚厦股份	10,397,579.54	9.27
19	002056	横店东磁	10,188,813.15	9.08
20	002041	登海种业	10,128,143.07	9.03
21	600580	卧龙电气	9,835,486.33	8.77
22	000612	焦作万方	9,555,346.17	8.52
23	600111	包钢稀土	9,510,282.60	8.48
24	600581	八一钢铁	9,309,505.68	8.30
25	600970	中材国际	9,158,280.15	8.16
26	600123	兰花科创	9,117,122.18	8.13
27	002106	莱宝高科	9,029,412.02	8.05
28	000024	招商地产	8,822,960.54	7.86
29	002073	软控股份	8,779,597.90	7.82
30	000860	顺鑫农业	8,735,387.73	7.78
31	600048	保利地产	8,699,350.56	7.75
32	600809	山西汾酒	8,605,608.27	7.67
33	000983	西山煤电	8,599,956.64	7.66
34	002081	金螳螂	8,508,007.60	7.58
35	600537	海通集团	8,435,902.64	7.52
36	000960	锡业股份	8,428,013.22	7.51
37	600067	冠城大通	8,227,374.51	7.33
38	600366	宁波韵升	8,168,519.00	7.28
39	600644	乐山电力	7,989,090.90	7.12
40	002250	联化科技	7,804,722.82	6.96
41	002028	思源电气	7,596,352.00	6.77
42	601666	平煤股份	7,235,959.80	6.45
43	000651	格力电器	7,127,191.91	6.35
44	000963	华东医药	7,074,463.79	6.30
45	000848	承德露露	6,661,676.50	5.94
46	000538	云南白药	6,556,039.47	5.84
47	600458	时代新材	6,439,505.19	5.74
48	600079	人福医药	6,170,884.96	5.50
49	600563	法拉电子	5,881,517.78	5.24
50	600707	彩虹股份	5,879,492.39	5.24
51	002154	报喜鸟	5,766,801.15	5.14
52	600036	招商银行	5,649,479.99	5.03
53	600104	上海汽车	5,579,598.00	4.97
54	002146	荣盛发展	5,512,904.90	4.91
55	600330	天通股份	5,437,311.67	4.85
56	600489	中金黄金	5,421,246.30	4.83
57	002024	苏宁电器	5,355,236.38	4.77
58	002007	华兰生物	5,273,280.25	4.70
59	002123	荣信股份	5,190,764.40	4.63
60	002069	獐子岛	5,135,997.87	4.58
61	601111	中国国航	5,113,769.40	4.56
62	600518	康美药业	5,111,188.19	4.56
63	600276	恒瑞医药	5,109,358.11	4.55
64	000501	鄂武商A	5,025,751.43	4.48
65	000998	隆平高科	5,022,808.50	4.48
66	600585	海螺水泥	4,830,981.01	4.31
67	600307	酒钢宏兴	4,715,952.42	4.20
68	000012	南玻A	4,702,356.00	4.19
69	002045	广州国光	4,505,250.95	4.02
70	002089	新海宜	4,393,924.60	3.92
71	600231	凌钢股份	4,329,433.31	3.86
72	000401	冀东水泥	4,270,907.44	3.81
73	000898	鞍钢股份	4,233,162.87	3.77
74	002241	歌尔声学	4,150,656.20	3.70
75	000829	天音控股	4,131,870.50	3.68
76	002158	汉钟精机	4,127,772.66	3.68
77	000877	天山股份	4,003,348.00	3.57
78	300041	回天胶业	3,973,547.00	3.54
79	601168	西部矿业	3,971,553.00	3.54
80	000973	佛塑股份	3,953,191.99	3.52
81	600354	敦煌种业	3,944,204.19	3.52
82	600884	杉杉股份	3,898,907.96	3.47
83	000001	深发展A	3,868,248.65	3.45
84	002142	宁波银行	3,857,857.40	3.44
85	600425	青松建化	3,802,358.50	3.39
86	002063	远光软件	3,771,256.04	3.36
87	601788	光大证券	3,745,357.11	3.34
88	600118	中国卫星	3,563,994.00	3.18
89	600993	马应龙	3,525,417.10	3.14
90	000970	中科三环	3,486,974.75	3.11
91	600549	厦门钨业	3,455,977.64	3.08
92	600600	青岛啤酒	3,395,388.77	3.03
93	000759	武汉中百	3,324,383.83	2.96
94	002038	双鹭药业	3,206,751.86	2.86
95	000559	万向钱潮	3,196,900.00	2.85
96	000811	烟台冰轮	3,196,704.55	2.85
97	002304	洋河股份	3,162,735.38	2.82
98	000528	柳工	3,159,340.90	2.82
99	600197	伊力特	3,158,219.10	2.81
100	002344	海宁皮城	3,134,383.85	2.79
101	300039	上海凯宝	3,101,081.60	2.76
102	600199	金种子酒	3,061,612.56	2.73
103	601988	中国银行	3,033,500.00	2.70
104	002086	东方海洋	3,017,636.58	2.69
105	601898	中煤能源	3,001,115.13	2.67
106	600739	辽宁成大	2,982,211.00	2.66
107	002048	宁波华翔	2,971,143.90	2.65
108	601398	工商银行	2,937,000.00	2.62
109	600460	士兰微	2,930,369.39	2.61
110	002152	广电运通	2,909,367.83	2.59
111	002029	七匹狼	2,857,471.39	2.55
112	002001	新和成	2,845,084.90	2.54
113	600416	湘电股份	2,799,925.55	2.50
114	600895	张江高科	2,798,081.77	2.49
115	600487	亨通光电	2,797,369.50	2.49
116	000823	超声电子	2,791,434.40	2.49
117	002008	大族激光	2,783,281.00	2.48
118	600693	东百集团	2,777,852.46	2.48
119	600271	航天信息	2,700,870.00	2.41
120	002293	罗莱家纺	2,678,784.00	2.39
121	600266	北京城建	2,673,513.00	2.38
122	600873	梅花集团	2,640,312.50	2.35
123	600694	大商股份	2,613,603.59	2.33
124	600785	新华百货	2,604,920.00	2.32
125	601299	中国北车	2,557,214.18	2.28
126	600690	青岛海尔	2,535,074.00	2.26
127	300086	康芝药业	2,528,456.00	2.25
128	000596	古井贡酒	2,497,059.00	2.23
129	600519	贵州茅台	2,485,765.00	2.22
130	600066	宇通客车	2,473,419.40	2.20
131	601186	中国铁建	2,469,320.00	2.20
132	002415	海康威视	2,455,068.50	2.19
133	002003	伟星股份	2,440,687.30	2.18
134	000926	福星股份	2,400,351.42	2.14
135	002232	启明信息	2,399,262.60	2.14
136	002138	顺络电子	2,391,592.00	2.13
137	002023	海特高新	2,382,776.40	2.12
138	002243	通产丽星	2,289,589.00	2.04
139	600987	航民股份	2,276,407.51	2.03

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

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	601169	北京银行	32,068,374.28	28.58
2	601318	中国平安	21,933,397.06	19.55
3	601009	南京银行	19,204,051.79	17.11
4	601601	中国太保	18,824,685.02	16.78
5	601166	兴业银行	18,391,938.45	16.39
6	000423	东阿阿胶	18,180,938.30	16.20
7	000933	神火股份	15,242,677.73	13.58
8	600594	益佰制药	14,130,272.47	12.59
9	600348	国阳新能	14,027,867.48	12.50
10	000858	五粮液	13,380,834.41	11.92
11	601699	潞安环能	12,517,446.36	11.16
12	600887	伊利股份	12,414,628.00	11.06
13	600188	兖州煤业	12,239,405.12	10.91
14	002252	上海莱士	11,812,419.93	10.53
15	600581	八一钢铁	11,740,886.40	10.46
16	600261	阳光照明	11,341,151.42	10.11
17	002375	亚厦股份	11,299,147.75	10.07
18	600123	兰花科创	11,162,625.38	9.95
19	000983	西山煤电	11,085,129.23	9.88
20	600111	包钢稀土	10,790,033.18	9.62
21	002056	横店东磁	10,759,973.04	9.59
22	600000	浦发银行	10,563,263.97	9.41
23	002041	登海种业	10,262,098.28	9.15
24	600580	卧龙电气	9,827,110.80	8.76
25	600362	江西铜业	9,785,072.60	8.72
26	002106	莱宝高科	9,615,338.36	8.57
27	000612	焦作万方	9,599,070.50	8.55
28	600970	中材国际	9,519,774.36	8.48
29	600048	保利地产	9,438,581.14	8.41
30	600537	海通集团	8,879,759.10	7.91
31	000860	顺鑫农业	8,866,397.76	7.90
32	000024	招商地产	8,786,979.97	7.83
33	002073	软控股份	8,553,706.32	7.62
34	000651	格力电器	8,246,748.19	7.35
35	600644	乐山电力	8,198,408.38	7.31
36	600067	冠城大通	8,064,541.20	7.19
37	600366	宁波韵升	7,976,171.70	7.11
38	600809	山西汾酒	7,825,655.61	6.97
39	000960	锡业股份	7,756,887.11	6.91
40	002081	金螳螂	7,443,143.91	6.63
41	002028	思源电气	7,435,942.00	6.63
42	002250	联化科技	7,007,101.34	6.24
43	601666	平煤股份	6,988,333.61	6.23
44	000963	华东医药	6,934,994.81	6.18
45	000848	承德露露	6,897,052.31	6.15
46	000538	云南白药	6,822,903.40	6.08
47	600707	彩虹股份	6,821,601.50	6.08
48	600519	贵州茅台	6,037,779.95	5.38
49	600231	凌钢股份	5,956,441.00	5.31
50	600079	人福医药	5,954,698.26	5.31
51	600458	时代新材	5,948,341.70	5.30
52	600785	新华百货	5,943,366.00	5.30
53	002154	报喜鸟	5,917,456.53	5.27
54	600104	上海汽车	5,815,807.35	5.18
55	600563	法拉电子	5,759,285.52	5.13
56	002007	华兰生物	5,740,586.00	5.12
57	600036	招商银行	5,455,979.06	4.86
58	002024	苏宁电器	5,405,404.94	4.82
59	600518	康美药业	5,402,194.80	4.81
60	000501	鄂武商A	5,351,610.04	4.77
61	600330	天通股份	5,310,204.86	4.73
62	002069	獐子岛	5,256,081.08	4.68
63	600489	中金黄金	5,240,668.26	4.67
64	601111	中国国航	5,206,008.46	4.64
65	002123	荣信股份	5,195,059.38	4.63
66	600276	恒瑞医药	5,114,701.46	4.56
67	000998	隆平高科	5,039,375.62	4.49
68	000898	鞍钢股份	4,858,335.79	4.33
69	600307	酒钢宏兴	4,815,099.00	4.29
70	000012	南玻A	4,547,927.94	4.05
71	002045	广州国光	4,474,799.38	3.99
72	600197	伊力特	4,425,042.34	3.94
73	002158	汉钟精机	4,401,091.15	3.92
74	002146	荣盛发展	4,368,547.51	3.89
75	002089	新海宜	4,339,947.86	3.87
76	601788	光大证券	4,299,486.99	3.83
77	600690	青岛海尔	4,295,117.25	3.83
78	300041	回天胶业	4,242,144.20	3.78
79	000829	天音控股	4,241,229.68	3.78
80	002241	歌尔声学	4,240,724.38	3.78
81	000877	天山股份	4,216,669.65	3.76
82	600425	青松建化	4,194,925.60	3.74
83	600884	杉杉股份	4,140,675.01	3.69
84	600354	敦煌种业	4,064,541.00	3.62
85	000759	武汉中百	3,994,576.40	3.56
86	601168	西部矿业	3,956,883.00	3.53
87	000973	佛塑股份	3,936,700.96	3.51
88	002142	宁波银行	3,789,172.47	3.38
89	000401	冀东水泥	3,779,062.97	3.37
90	600118	中国卫星	3,708,328.49	3.30
91	600585	海螺水泥	3,699,191.10	3.30
92	000001	深发展A	3,594,190.40	3.20
93	600549	厦门钨业	3,504,151.50	3.12
94	000970	中科三环	3,399,285.21	3.03
95	300039	上海凯宝	3,394,162.84	3.02
96	002038	双鹭药业	3,342,612.48	2.98
97	000811	烟台冰轮	3,256,583.38	2.90
98	600199	金种子酒	3,245,889.00	2.89
99	000559	万向钱潮	3,234,177.00	2.88
100	002086	东方海洋	3,228,967.42	2.88
101	600600	青岛啤酒	3,214,235.00	2.86
102	002304	洋河股份	3,211,015.27	2.86
103	002344	海宁皮城	3,147,865.41	2.81
104	000792	盐湖钾肥	3,137,367.50	2.80
105	000528	柳工	3,124,820.00	2.78
106	600993	马应龙	3,085,828.24	2.75
107	002029	七匹狼	3,019,448.95	2.69
108	601898	中煤能源	3,018,880.73	2.69
109	002078	太阳纸业	2,995,131.50	2.67
110	002048	宁波华翔	2,979,163.01	2.65
111	600693	东百集团	2,968,248.00	2.65
112	600508	上海能源	2,962,113.22	2.64
113	600739	辽宁成大	2,961,100.00	2.64
114	600806	昆明机床	2,936,693.25	2.62
115	600895	张江高科	2,931,412.22	2.61
116	601398	工商银行	2,924,074.50	2.61
117	601988	中国银行	2,909,350.00	2.59
118	000635	英力特	2,893,534.58	2.58
119	601628	中国人寿	2,855,514.14	2.54
120	600487	亨通光电	2,815,784.83	2.51
121	600271	航天信息	2,809,187.00	2.50
122	600460	士兰微	2,804,757.73	2.50
123	002001	新和成	2,785,577.93	2.48
124	600694	大商股份	2,756,381.97	2.46
125	600873	梅花集团	2,743,455.00	2.44
126	000823	超声电子	2,734,289.33	2.44
127	600828	成商集团	2,688,246.00	2.40
128	000596	古井贡酒	2,678,261.21	2.39
129	600416	湘电股份	2,659,145.85	2.37
130	000488	晨鸣纸业	2,589,983.79	2.31
131	601299	中国北车	2,585,350.00	2.30
132	600066	宇通客车	2,583,472.07	2.30
133	601607	上海医药	2,561,296.00	2.28
134	002065	东华软件	2,551,873.00	2.27
135	002003	伟星股份	2,551,440.00	2.27
136	600266	北京城建	2,537,901.00	2.26
137	601186	中国铁建	2,501,184.00	2.23
138	600418	江淮汽车	2,436,499.00	2.17
139	002187	广百股份	2,416,049.00	2.15
140	002200	绿大地	2,337,692.66	2.08
141	002023	海特高新	2,330,942.00	2.08
142	000661	长春高新	2,293,901.90	2.04
143	002063	远光软件	2,266,838.03	2.02
144	300086	康芝药业	2,244,748.00	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	1,132,417,733.26
卖出股票的收入（成交）总额	1,173,850,109.89

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,299,991.10	4.76
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	2,040,483.60	2.95
7	其他	-	-
8	合计	5,340,474.70	7.71

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	8,000	945,120.00	1.36
2	111051	09怀化债	8,690	910,625.10	1.31
3	126018	08江铜债	11,100	862,359.00	1.24
4	126015	08康美债	8,000	684,560.00	0.99
5	113001	中行转债	5,630	618,511.80	0.89

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	69,613.94
2	应收证券清算款	2,333,635.74
3	应收股利	-
4	应收利息	83,410.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,486,660.03

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110007	博汇转债	354,720.00	0.51
2	113001	中行转债	618,511.80	0.89

8.9.5 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未存在流通受限情况。

§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
4,423	11,719.77	19,989,005.50	38.56%	31,847,549.41	61.44%

9.2 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	44,861.53	0.09%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日（2008年11月5日）基金份额总额	238,722,490
本报告期期初基金份额总额	89,886,755.65
本报告期基金总申购份额	32,182,368.29
减:本报告期基金总赎回份额	70,232,569.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,836,554.91

注:总申购份额包含转换入份额;总赎回份额含转换出份额

§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,本基金的基金管理人高层管理人员无重大人事变更。经诺德基金管理有限公司总经理办公会议讨论通过,决定自2010年2月24日起聘任向朝勇先生担任本基金基金经理,戴奇雷先生不再担任本基金基金经理职务。2010年3月2日,经诺德基金管理有限公司总经理办公会议讨论通过,同意张学东先生因个人原因辞去所担任的本基金基金经理职务的请求,本基金由向朝勇先生单独管理。

（2）本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2011年1月31日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作）,其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

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

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所有限公司担任本基金2010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为5万元。目前普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金提供连续2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监管部门稽查或处罚的情形。

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	
长江证券	2	198,647,363.52	8.62%	163,556.31	8.52%	-
华泰联合证券	1	137,030,557.59	5.94%	111,338.16	5.80%	-
海通证券	1	46,214,866.91	2.00%	39,282.51	2.05%	-
平安证券	2	29,634,445.03	1.29%	25,189.28	1.31%	-
银河证券	2	3,549,166.83	0.15%	2,883.76	0.15%	-
申银万国	1	498,966,809.86	21.64%	424,120.66	22.10%	-
中信证券	2	472,546,355.04	20.49%	383,947.01	20.01%	-
中金公司	1	239,236,111.82	10.38%	203,349.31	10.60%	-
中银国际	1	7,131,085.24	0.31%	6,061.50	0.32%	-
招商证券	1	28,420,100.11	1.23%	24,156.94	1.26%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	22,771,049.20	0.99%	19,355.42	1.01%	-
湘财证券	1	60,750,617.44	2.63%	51,637.86	2.69%	-
中信建投	1	27,208,544.47	1.18%	23,127.11	1.21%	-
山西证券	1	26,424,495.40	1.15%	22,460.85	1.17%	-
国泰君安	1	34,689,746.31	1.50%	29,485.82	1.54%	-
光大证券	1	54,196,002.71	2.35%	46,066.38	2.40%	-
国信证券	2	28,275,093.78	1.23%	23,076.07	1.20%	-
中投证券	1	19,202,939.43	0.83%	16,322.40	0.85%	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	90,843,502.48	3.94%	74,389.23	3.88%	-
东方证券	1	152,607,939.66	6.62%	123,995.43	6.46%	-
国金证券	1	29,141,800.27	1.26%	23,677.83	1.23%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	52,051,007.30	2.26%	42,291.72	2.20%	-
东海证券	1	46,237,270.75	2.01%	39,301.42	2.05%	-
合计	34	2,305,776,871.15	100.00%	1,919,072.98	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。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

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:东海证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司;退租如下基金专用交易单元:长城证券有限责任公司。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人诺德基金管理有限公司对本报告期后重大事项披露如下:

2011年1月21日,诺德基金管理公司增聘王正先生担任诺德主题灵活配置混合型基金基金经理,与向朝勇先生共同管理诺德主题灵活配置混合型基金。

2011年3月12日,经诺德基金管理有限公司总经理办公会议讨论通过,向朝勇先生因工作需要不再担任诺德主题灵活配置混合型基金基金经理,由王正先生单独管理本基金。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

2010年1月29日,托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告,决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告,范一飞先生已提出辞呈,辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告,每10股派发现金股息人民币2.02元（含税）。

2010年9月15日,托管人中国建设银行股份有限公司发布公告,张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长,谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

诺德基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日