

诺安平衡证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年7月18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,保证复核内容真实、准确和完整,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,也不保证基金资产净值不受损失,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。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2011年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况
基金名称:诺安平衡混合
基金代码:320008

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年5月21日
报告期末基金份额总额:9,824,096,152.46份

投资目标:本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下,追求当期稳定的绝对回报以及长期的资本增值。

投资策略:本基金采取积极的投资策略,在宏观审慎配置基础上,本基金关注市场估值性价比,在个股选择上,本基金注重基本面和估值性价比,在个股选择上,本基金注重基本面和估值性价比。

业绩比较基准:65%\*中信指数+35%\*上证国债指数
风险收益特征:诺安平衡证券投资基金属于混合型基金,风险高于股票型基金,收益水平高于债券型基金。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -46,364,235.45
2.本期利润 -427,183,422.63
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0444

4.期末基金资产净值 7,202,537,668.78
5.期末基金份额净值 0.7332

注:①上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易的各项费用,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

过去三个月 -5.67% 0.70% -3.90% 0.76% -1.77% 0.00%

注:本基金的业绩比较基准为:65%\*中信指数+35%\*上证国债指数。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理 钱慧敏 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

林慧敏 本基金的基金经理 2008年1月21日 2011年4月16日 8

夏晓光 本基金的基金经理 2011年4月16日 5

注:①此处的任职日期和离任日期为公作出决定并对外公告之日;
②证券从业的年限以行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定为准。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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

4.3.3 异常交易行为的专项说明
4.3.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年的经济环境异常复杂,抑制通胀"将是政府今年的第一要务,而这轮通胀的本质是经济增速放缓方式遭通胀的外在表现,因此,在不发生经济硬着陆的前提下,通胀问题的最终解决实际上需要成功的经济转型。

二季度,本基金进行了较大的持仓调整,但市场上下跌带来的成交量的迅速萎缩延缓了调仓的进程,从结构上看,减持了有色金属、机械等周期性的行业,增持了医药、软件等消费类行业。

截至报告期末,本基金份额净值为0.7332元,本报告期基金份额净值增长率为-5.67%,同期业绩比较基准收益率为-3.90%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 基金产品概况
基金名称:诺安平衡混合
基金代码:320008

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年5月21日
报告期末基金份额总额:85,145,296.18份

投资目标:本基金通过投资于核心固定收益类资产上,进行长期稳健投资,力争在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力,使基金资产在可控风险的前提下实现长期增值。

投资策略:本基金的投资策略分为核心资产配置策略和增强类资产配置策略两大部分。
1.核心资产配置策略

2.增强类资产配置策略
股票(包括新股申购)、权证等非固定收益类金融工具为本基金的增强类资产,此部分资产在承担市场风险的基础上追求超额收益的最大化增值。

业绩比较基准:中债综合全价指数
风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -1,180,914.43
2.本期利润 -1,250,402.81
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131

4.期末基金资产净值 89,476,029.76
5.期末基金份额净值 1.061

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易的各项费用,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

过去三个月 -1.51% 0.09% 0.53% 0.04% -2.04% 0.05%

Table with 4 columns: 序号, 基金名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 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资产支持证券投资明细
5.7 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权证投资明细

5.8 其他资产构成
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现过被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 本基金投资的前十名证券,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.8.6 本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 项目, 单位:份

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。

5.10 备查文件目录
(一)中国证监会核准诺安平衡证券投资基金募集的文件。
(二)诺安平衡证券投资基金基金合同。

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人住所。
7.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

4.1 基金经理 钱慧敏 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

钱慧敏 本基金的基金经理 2009年9月16日 4

注:①此处的任职日期为公作出决定并对外公告之日;
②证券从业的年限以行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定为准。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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

4.3.3 异常交易行为的专项说明
4.3.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第二季度,在通胀压力和流动性过剩的多重作用下,二季度国内A股市场继续下跌,估值较低的中小板和创业板被投资者广泛看好,在连续上调准备金率后,债券市场出现政策宽松,7天回购利率一度超过9%的高点,在短期利率走高和通胀的冲击下,二季度债券收益率大幅上行创出09年以来的最高水平。

报告期内,由于对经济形势预期不乐观,我们采取防御性投资策略,增持债券类资产,维持较高比例的现金和信用债,降低股票仓位,较好地应对了股市和债市大幅下行的不利局面。

截至报告期末,诺安增利债券基金资产净值为1.041元,本报告期基金份额净值增长率为-1.51%,业绩比较基准中债综合全价指数收益率为0.53%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产的比例(%)

5.2 基金产品概况
基金名称:诺安增利债券
基金代码:320008

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年9月16日
报告期末基金份额总额:28,859,365.83份

投资目标:本基金通过投资于核心固定收益类资产上,进行长期稳健投资,力争在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力,使基金资产在可控风险的前提下实现长期增值。

投资策略:本基金的投资策略分为核心资产配置策略和增强类资产配置策略两大部分。
1.核心资产配置策略

诺安全球黄金证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年7月18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,保证复核内容真实、准确和完整,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,也不保证基金资产净值不受损失,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。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2011年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况
基金名称:诺安全球黄金(QDII-FOF)
基金代码:320013

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年4月13日
报告期末基金份额总额:1,572,313,421.07份

投资目标:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF,跟踪国际金价走势,为投资者提供一类可有效分散黄金风险的黄金类金融产品。

投资策略:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪国际金价的,本基金基金资产净值中投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF中,不低于基金资产净值50%的投资比例,但本基金持有的ETF份额,流动性等要素进行适当调整并平衡。本基金只买卖符合黄金ETF份额,不直接买卖实物黄金。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为伦敦金银市场协会黄金价格每盎司乘以伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 54,586,320.40
2.本期利润 73,609,277.00
3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 1,651,695,944.24
5.期末基金份额净值 1.050

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易的各项费用,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

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价折成人民币后收益,伦敦金每个工作日采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理 钱慧敏 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

钱慧敏 本基金的基金经理 2011年4月13日 13

注:①此处的任职日期为公作出决定并对外公告之日;
②证券从业的年限以行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定为准。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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

4.3.3 异常交易行为的专项说明
4.3.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第二季度,在通胀压力和流动性过剩的多重作用下,二季度国内A股市场继续下跌,估值较低的中小板和创业板被投资者广泛看好,在连续上调准备金率后,债券市场出现政策宽松,7天回购利率一度超过9%的高点,在短期利率走高和通胀的冲击下,二季度债券收益率大幅上行创出09年以来的最高水平。

报告期内,由于对经济形势预期不乐观,我们采取防御性投资策略,增持债券类资产,维持较高比例的现金和信用债,降低股票仓位,较好地应对了股市和债市大幅下行的不利局面。

截至报告期末,诺安增利债券基金资产净值为1.041元,本报告期基金份额净值增长率为-1.51%,业绩比较基准中债综合全价指数收益率为0.53%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产的比例(%)

5.2 基金产品概况
基金名称:诺安增利债券
基金代码:320008

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年9月16日
报告期末基金份额总额:28,859,365.83份

投资目标:本基金通过投资于核心固定收益类资产上,进行长期稳健投资,力争在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力,使基金资产在可控风险的前提下实现长期增值。

投资策略:本基金的投资策略分为核心资产配置策略和增强类资产配置策略两大部分。
1.核心资产配置策略

2.增强类资产配置策略
股票(包括新股申购)、权证等非固定收益类金融工具为本基金的增强类资产,此部分资产在承担市场风险的基础上追求超额收益的最大化增值。

业绩比较基准:中债综合全价指数
风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 54,586,320.40
2.本期利润 73,609,277.00
3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 1,651,695,944.24
5.期末基金份额净值 1.050

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易的各项费用,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

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

通胀上行速度,因此全球利率环境没有改变,2011年第二季度还有扩大趋势。由于实际利率持续为负,个人投资者购买黄金的保值需求更加旺盛,2011年度中国居民购买黄金的保值需求大幅度上升,因此成为全球黄金市场最大的买家之一。

2011年第二季度美元震荡走低,美联储利率政策以及美国政府债务风险,是压在美元之上的两座大山,这两者在短期内无法改变,因此美元贬值趋势也不会改变。由于美元持续贬值,世界各国外汇市场是新兴市场国家央行降低美元在外汇储备中的比例,提高黄金在外汇储备中的比例,2011年度及新兴市场国家央行大量买进黄金,因此成为全球黄金市场的一个大买家。

回顾2011年第二季度,全球仍然是高利率环境,美元指数持续贬值,中国居民以及新兴市场国家央行成为黄金市场最大的买家,2011年第二季度国际金价持续上行,并且在2011年4月超越1500美元。

2011年第二季度基金仓位维持在95%上限,紧密跟踪黄金价格走势,分享了黄金价格上涨带来的收益,从而为本基金持有人创造了比较满意的回报。

5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产比例(%)

5.2 基金产品概况
基金名称:诺安全球黄金(QDII-FOF)
基金代码:320013

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年4月13日
报告期末基金份额总额:1,572,313,421.07份

投资目标:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF,跟踪国际金价走势,为投资者提供一类可有效分散黄金风险的黄金类金融产品。

投资策略:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪国际金价的,本基金基金资产净值中投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF中,不低于基金资产净值50%的投资比例,但本基金持有的ETF份额,流动性等要素进行适当调整并平衡。本基金只买卖符合黄金ETF份额,不直接买卖实物黄金。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为伦敦金银市场协会黄金价格每盎司乘以伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 54,586,320.40
2.本期利润 73,609,277.00
3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 1,651,695,944.24
5.期末基金份额净值 1.050

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易的各项费用,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

过去三个月 2.88% 0.78% 3.27% 0.99% -0.39% -0.21%

注:本基金的业绩比较基准为:伦敦金价折成人民币后收益,伦敦金每个工作日采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



4.1 基金经理 钱慧敏 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

钱慧敏 本基金的基金经理 2011年4月13日 13

注:①此处的任职日期为公作出决定并对外公告之日;
②证券从业的年限以行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定为准。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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

4.3.3 异常交易行为的专项说明
4.3.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第二季度,在通胀压力和流动性过剩的多重作用下,二季度国内A股市场继续下跌,估值较低的中小板和创业板被投资者广泛看好,在连续上调准备金率后,债券市场出现政策宽松,7天回购利率一度超过9%的高点,在短期利率走高和通胀的冲击下,二季度债券收益率大幅上行创出09年以来的最高水平。

报告期内,由于对经济形势预期不乐观,我们采取防御性投资策略,增持债券类资产,维持较高比例的现金和信用债,降低股票仓位,较好地应对了股市和债市大幅下行的不利局面。

截至报告期末,诺安增利债券基金资产净值为1.041元,本报告期基金份额净值增长率为-1.51%,业绩比较基准中债综合全价指数收益率为0.53%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产比例(%)

5.2 基金产品概况
基金名称:诺安全球黄金(QDII-FOF)
基金代码:320013

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年4月13日
报告期末基金份额总额:1,572,313,421.07份

投资目标:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF,跟踪国际金价走势,为投资者提供一类可有效分散黄金风险的黄金类金融产品。

投资策略:本基金主要投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪国际金价的,本基金基金资产净值中投资于境外有实物黄金支持的黄金ETF中,不低于基金资产净值50%的投资比例,但本基金持有的ETF份额,流动性等要素进行适当调整并平衡。本基金只买卖符合黄金ETF份额,不直接买卖实物黄金。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为伦敦金银市场协会黄金价格每盎司乘以伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)

1.本期已实现收益 54,586,320.40
2.本期利润 73,609,277.00
3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 1,651,695,944.24
5.期末基金份额净值 1.050

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易的各项费用,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。

诺安增利债券型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年7月18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,保证复核内容真实、准确和完整,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。