诺德中小盘股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6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
送出日期：二〇一一年八月二十五日

1重要提示及目录

1.1 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2011年8月24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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本半年度报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

2基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德中小盘股票型证券投资基金
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
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	318,246,000.95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	天相中盘指数×40%+天相小盘指数×40%+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。

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	张欣	唐州徽
	联系电话	021-68879999	010-66594855
	电子邮箱	xin.zhang@lordabbettchina.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68877727	010-66594942

2.4 信息披露方式

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	本基金半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（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	-29,461,481.13
本期利润	-44,482,777.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1356
本期加权平均净值利润率	-13.61%
本期基金份额净值增长率	-13.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011年6月30日）
期末可供分配利润	-24,067,251.70
期末可供分配基金份额利润	-0.0756
期末基金资产净值	299,642,929.98
期末基金份额净值	0.942
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-3.16%

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。

3.2 基金净值表现

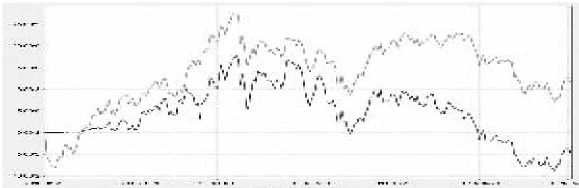
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.09%	1.12%	2.39%	1.05%	1.70%	0.07%
过去三个月	-7.19%	1.08%	-5.41%	0.99%	-1.78%	0.09%
过去六个月	-13.10%	1.25%	-3.75%	1.06%	-9.35%	0.19%
过去一年	-3.16%	1.34%	20.58%	1.19%	-23.74%	0.15%
自基金合同生效起至今	-3.16%	1.33%	13.01%	1.22%	-16.17%	0.11%

注：业绩比较基准=天相中盘指数＊40%+天相小盘指数＊40%+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

诺德中小盘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
（2010年6月28日至2011年6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2011年6月30日。本基金建仓期间自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，公司管理了六只开放式基金：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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
向朝勇	本基金基金经理，诺德优选30股票型证券投资基金基金经理，公司投资总监	2010-06-28	-	14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，现担任公司投资总监，诺德优选30股票型证券投资基金基金经理及本基金基金经理，具有基金从业资格。

注：任职日期是指本公司总经理办公会做出决定之日；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，不存在与诺德中小盘股票型基金风格类似的投资组合，公司旗下另五只基金产品分别为价值股票型基金、成长股票型基金、集中持股股票型基金、混合型基金和债券型基金，六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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年A股市场在通胀压力持续升温、宏观调控持续加大力度的大环境下走出了先扬后抑的行情。一季度，由于PPI还处于高位，在生产资料及资源价格的上涨推动下，部分中上游周期性行业业绩表现出色，周期性股票有一波较大幅度的上涨，尤其建材、化工、钢铁及煤炭都有较大涨幅，金融行业也有阶段性表现，指数出现了冲高走势，但中小市值个股由于去年的大幅炒作，一季度出现了深度下跌，结构分化明显。二季度，由于市场担心宏观经济出现超调，市场出现了连续下跌，尤其周期性行业下跌幅度较大，而一些前期下跌较多而业绩又比较稳定的非周期性行业却逐步走出底部，并有一定程度的上涨，尤其以食品饮料中的白酒为代表。

2011年半年度，本基金由于根据基金契约，开年以来中小市值个股持有比例较高，净值损失较大，尤以TMT行业损失最大，其次是医药行业，由于周期性行业配置比例较低，因此一季度中后期适当增加了周期性行业配置权重，但由于买进时点不好，不仅没有获取收益，反而对基金净值造成进一步损失，一季度唯一抓住的周期性行业是水泥。二季度，本基金加大了个股研究力度，利用优质中小市值个股的超跌机会，增加了对非周期性的优质成长个股的配置力度，尤其是对白酒及医药超配，逐步挽回损失。但由于配置力度及个股精选方面都还有不足之处，因此基金净值表现仍然落后比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日，本基金份额净值为0.942元，累计净值为0.972元。本报告期份额净值增长率为-13.10%，同期业绩比较基准增长率为-3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年下半年，通货膨胀可能3季度见顶，4季度回落；经济增长总体呈现稳步回落态势；宏观政策趋于稳定，但政策全面转向概率很小。因此，我们判断A股市场的估值中枢难以提升，市场将维持区间震荡走势，其中成长确定性较高的行业和个股将获得估值溢价。

从配置层面看，我们将深入挖掘信息技术、生物医药、食品饮料、纺织服装、商业贸易、煤炭、有色金属、节能环保等领域的成长性细分行业，并重点投资致力于自身品牌塑造的高成长个股。

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

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，完全尽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：诺德中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,965,885.12	21,105,764.27
结算备付金		2,592,766.98	3,461,165.53
存出保证金		2,594,721.65	1,500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	282,728,265.25	324,350,657.83
其中：股票投资		265,770,765.25	324,350,657.83
基金投资		-	-
债券投资		16,957,500.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	13,500,000.00	5,000,000.00
应收证券清算款		3,818,786.14	4,326,923.95
应收利息	6.4.7.5	352,564.39	7,449.59
应收股利		25,200.00	-
应收申购款		178,426.85	2,598,034.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		307,756,616.38	362,349,995.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		4,079,768.22	3,380,232.73
应付赎回款		53,144.63	1,552,606.10
应付管理人报酬		357,536.66	485,948.34
应付托管费		59,589.45	80,991.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	857,973.46	990,083.92
应交税费		12,075.20	12,075.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,693,598.78	1,965,851.49
负债合计		8,113,686.40	8,467,789.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	318,246,000.95	326,396,093.99
未分配利润	6.4.7.10	-18,603,070.97	27,486,112.58
所有者权益合计		299,642,929.98	353,882,206.57
负债和所有者权益总计		307,756,616.38	362,349,995.74

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.942元，基金份额总额318,246,000.95份。

6.2 利润表

会计主体：诺德中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010年6月30日
一、收入		-37,037,527.64	52,030.85
1.利息收入		292,602.88	41,716.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	98,070.04	16,666.95
债券利息收入		103,700.00	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		90,832.84	25,049.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		-22,429,212.28	-11,500.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-23,700,355.12	-11,500.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,271,142.84	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	6.4.7.15	-15,021,296.26	-
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	6.4.7.16	120,378.02	21,814.22
减：二、费用		7,445,249.75	39,364.15
1.管理人报酬		2,438,340.50	29,884.82
2.托管费		406,390.08	4,980.81
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.17	4,389,852.59	1,129.52
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.18	210,666.58	3,369.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-44,482,777.39	12,666.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-44,482,777.39	12,666.70

注：本基金合同生效日为2010年6月28日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	326,396,093.99	27,486,112.58	353,882,206.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,482,777.39	-44,482,777.39
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）	-8,150,093.04	-1,606,406.16	-9,756,499.20
其中：1.基金申购款	84,275,880.99	2,355,486.88	86,631,367.87
2.基金赎回款	-92,425,974.03	-3,961,893.04	-96,387,867.07
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）	318,246,000.95	-18,603,070.97	299,642,929.98
项目	上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010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）	363,570,378.53	-	363,570,378.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,666.70	12,666.70
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	363,570,378.53	12,666.70	363,583,045.23

注：1、本基金合同生效日为2010年6月28日。

2、报告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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德中小盘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?2010］第270号《关于核准诺德中小盘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《诺德中小盘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363,552,185.17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（2010）第169号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2010年6月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为363,570,378.53份基金份额，其中认购资金利息折合18,193.36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》和《诺德中小盘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、权证等权益类资产投资比例占基金资产的60%-95%；债券、债券回购、银行存款等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的5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金投资权证的比例不超过资产的3%。本基金的业绩比较基准为：天相中盘指数×40%+天相小盘指数×40%+上证国债指数×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》、《诺德中小盘股票型证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年1月1日至2011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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至2011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

本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本报告期内本基金未发生会计政策变更事项、会计估计变更事项及会计差错更正事项。

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［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。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

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010年6月30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	606,517,166.06	20.98%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	492,799.07	20.49%	234,114.39	27.29%

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。

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,438,340.50	29,884.82
其中：支付销售机构的客户维护费	781,147.98	8,496.62

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	406,390.08	4,980.81

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

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010年6月30日
基金合同生效日（2010年6月28日）持有的基金份额	-	10,000,400.04
期初持有的基金份额	10,000,400.04	-
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	10,000,400.04	10,000,400.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.14%	2.75%

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年6月28日（基金合同生效日）至2010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	1,965,885.12	75,304.06	226,206,474.27	16,666.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 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投资组合报告

7.1 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	265,770,765.25	86.36
	其中：股票	265,770,765.25	86.36
2	固定收益投资	16,957,500.00	5.51
	其中：债券	16,957,500.00	5.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	13,500,000.00	4.39
	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	4,558,652.10	1.48
6	其他各项资产	6,969,699.03	2.26
7	合计	307,756,616.38	100.00

7.2 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	968,194.50	0.32
B	采掘业	29,694,396.47	9.91
C	制造业	206,730,260.87	68.99
C0	食品、饮料	47,240,334.82	15.77
C1	纺织、服装、皮毛	9,989,621.80	3.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	860,200.00	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,895,494.30	2.30
C5	电子	16,013,707.59	5.34
C6	金属、非金属	66,010,723.24	22.03
C7	机械、设备、仪表	25,631,556.80	8.55
C8	医药、生物制品	34,088,622.32	11.38
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,410,446.85	2.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	7,087,065.56	2.37
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	7,437,100.00	2.48
J	房地产业	2,784,501.00	0.93
K	社会服务业	960,750.00	0.32
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,698,050.00	1.23
	合计	265,770,765.25	88.70

7.3 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	600362	江西铜业	495,000	17,542,800.00	5.85
2	000858	五粮液	475,026	16,967,928.72	5.66
3	600585	海螺水泥	486,048	13,492,692.48	4.50
4	600519	贵州茅台	53,018	11,273,217.34	3.76
5	600188	兖州煤业	311,464	10,994,679.20	3.67
6	000877	天山股份	309,153	10,987,297.62	3.67
7	600252	中恒集团	566,000	10,533,260.00	3.52
8	000568	泸州老窖	224,850	10,145,232.00	3.39
9	600031	三一重工	530,000	9,561,200.00	3.19
10	600079	人福医药	409,448	9,032,422.88	3.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600585	海螺水泥	54,713,686.80	15.46
2	000423	东阿阿胶	37,318,123.65	10.55
3	000858	五粮液	35,945,334.23	10.16
4	000877	天山股份	34,011,277.48	9.61
5	600362	江西铜业	33,517,646.76	9.47
6	000338	潍柴动力	27,134,781.01	7.67
7	601009	南京银行	24,887,282.50	7.03
8	000630	铜陵有色	24,353,753.37	6.88
9	000568	泸州老窖	24,077,636.38	6.80
10	601166	兴业银行	21,413,066.69	6.05
11	600079	人福医药	21,227,118.72	6.00
12	601169	北京银行	20,897,361.66	5.91
13	600348	阳泉煤业	20,882,713.61	5.90
14	002081	金螳螂	20,693,766.80	5.85
15	600383	金地集团	20,019,750.00	5.66
16	000528	柳工	18,936,467.18	5.35
17	600048	保利地产	18,596,729.12	5.26
18	600518	康美药业	18,462,726.50	5.22
19	600522	中天科技	17,986,768.08	5.08
20	600188	兖州煤业	17,095,947.98	4.83
21	600458	时代新材	16,980,533.32	4.80
22	600030	中信证券	15,993,765.86	4.52
23	000024	招商地产	15,953,813.21	4.51
24	002073	软控股份	15,622,453.23	4.41
25	601101	昊华能源	15,548,693.88	4.39
26	000629	攀钢钒钛	15,172,630.14	4.29
27	000422	湖北宜化	14,857,697.49	4.20
28	601989	中国重工	14,651,457.00	4.14
29	600582	天地科技	14,453,560.20	4.08
30	600031	三一重工	14,139,400.00	4.00
31	600519	贵州茅台	14,005,381.49	3.96
32	002344	海宁皮城	13,883,684.90	3.92
33	601117	中国化学	13,875,105.00	3.92
34	601186	中国铁建	13,703,301.00	3.87
35	000157	中联重科	13,480,777.76	3.81
36	601717	郑煤机	13,428,437.12	3.79
37	601601	中国太保	13,122,721.60	3.71
38	000680	山推股份	12,862,665.85	3.63
39	600000	浦发银行	12,758,823.64	3.61
40	002122	天马股份	12,645,941.38	3.57
41	600252	中恒集团	11,985,013.24	3.39
42	002244	滨江集团	11,904,074.79	3.36
43	600425	青松建化	11,829,763.70	3.34
44	002099	海翔药业	11,619,172.51	3.28
45	600809	山西汾酒	11,332,047.40	3.20
46	000401	冀东水泥	11,204,783.05	3.17
47	600487	亨通光电	10,946,576.77	3.09
48	600089	特变电工	10,922,990.08	3.09
49	600581	八一钢铁	10,833,695.60	3.06
50	600801	华新水泥	10,329,419.00	2.92
51	000063	中兴通讯	10,244,071.50	2.89
52	600318	巢东股份	10,124,235.63	2.86
53	000926	福星股份	10,010,211.75	2.83
54	600066	宇通客车	10,008,623.50	2.83
55	601318	中国平安	9,772,918.30	2.76
56	600150	中国船舶	8,936,901.60	2.53
57	002038	双鹭药业	8,749,177.00	2.47
58	002142	宁波银行	8,637,100.00	2.44
59	002375	亚厦股份	8,211,509.56	2.32
60	600067	冠城大通	8,207,881.67	2.32
61	600123	兰花科创	8,157,061.50	2.31
62	600231	凌钢股份	7,949,394.79	2.25
63	600460	士兰微	7,821,203.58	2.21
64	002055	得润电子	7,688,959.71	2.17
65	600426	华鲁恒升	7,605,931.00	2.15
66	002106	莱宝高科	7,458,659.20	2.11
67	600594	益佰制药	7,278,467.00	2.06
68	600802	福建水泥	7,226,601.00	2.04

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。

7.4.2 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	600585	海螺水泥	53,081,046.99	15.00
2	000423	东阿阿胶	40,414,151.25	11.42
3	000338	潍柴动力	26,766,060.43	7.56
4	000877	天山股份	25,789,518.57	7.29
5	002081	金螳螂	25,753,052.45	7.28
6	601166	兴业银行	25,588,731.00	7.23
7	000858	五粮液	24,902,642.12	7.04
8	601009	南京银行	24,453,156.61	6.91
9	000528	柳工	23,247,534.51	6.57
10	000630	铜陵有色	22,720,259.95	6.42
11	600048	保利地产	21,908,418.30	6.19
12	600348	阳泉煤业	21,148,976.45	5.98
13	601169	北京银行	20,516,971.00	5.80
14	601117	中国化学	19,616,960.78	5.54
15	600458	时代新材	17,899,542.50	5.06
16	000024	招商地产	17,439,198.80	4.93
17	600383	金地集团	17,059,063.02	4.82
18	601318	中国平安	16,919,019.25	4.78
19	600594	益佰制药	16,414,983.17	4.64
20	601601	中国太保	15,974,808.48	4.51
21	002073	软控股份	15,639,870.61	4.42
22	600522	中天科技	15,304,470.44	4.32
23	601989	中国重工	15,104,630.00	4.27
24	600030	中信证券	14,629,500.00	4.13
25	600518	康美药业	14,383,013.08	4.06
26	600079	人福医药	14,261,803.00	4.03
27	000422	湖北宜化	13,833,330.01	3.91
28	601186	中国铁建	13,792,779.84	3.90
29	600487	亨通光电	13,723,296.24	3.88
30	000568	泸州老窖	13,714,774.72	3.88
31	002244	滨江集团	13,704,522.39	3.87
32	002122	天马股份	13,431,397.46	3.80
33	601717	郑煤机	13,366,401.81	3.78
34	600582	天地科技	13,287,273.43	3.75
35	000401	冀东水泥	12,963,998.87	3.66
36	600801	华新水泥	12,720,611.14	3.59
37	000680	山推股份	12,720,576.05	3.59
38	600362	江西铜业	12,430,936.00	3.51
39	000926	福星股份	11,358,669.75	3.21
40	002099	海翔药业	11,358,447.98	3.21
41	002344	海宁皮城	11,227,498.74	3.17
42	600318	巢东股份	11,151,960.84	3.15
43	600809	山西汾酒	10,889,668.37	3.08
44	000063	中兴通讯	10,602,812.35	3.00
45	600089	特变电工	10,515,241.60	2.97
46	002375	亚厦股份	10,174,953.68	2.88
47	601101	昊华能源	10,065,598.97	2.84
48	000983	西山煤电	9,867,034.78	2.79
49	600970	中材国际	9,597,690.54	2.71
50	600425	青松建化	9,546,895.00	2.70
51	002304	洋河股份	9,508,888.00	2.69
52	002106	莱宝高科	9,395,305.59	2.65
53	600031	三一重工	9,292,538.97	2.63
54	600066	宇通客车	9,046,363.25	2.56
55	600150	中国船舶	9,010,404.38	2.55
56	600111	包钢稀土	8,928,641.18	2.52
57	600169	太原重工	8,673,585.50	2.45
58	000157	中联重科	8,668,900.00	2.45
59	600802	福建水泥	8,314,493.10	2.35
60	600460	士兰微	8,144,621.34	2.30
61	002142	宁波银行	8,010,851.90	2.26
62	000960	锡业股份	7,970,158.74	2.25
63	600426	华鲁恒升	7,817,206.00	2.21
64	600276	恒瑞医药	7,622,882.82	2.15
65	300115	长盈精密	7,241,796.78	2.05

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。7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,436,110,641.27
卖出股票的收入（成交）总额	1,456,031,782.47

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。

7.5 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	16,957,500.00	5.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	16,957,500.00	5.66

7.6 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	010112	21国债⑿	170,000	16,957,500.00	5.66

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内，于2011年4月29日，中国证券监督管理委员会发布《中国证监会行政处罚决定书》（2011【17】号），对宜宾五粮液股份有限公司（下称：五粮液，股票代码：000858）、唐桥等8名责任人员作出警告、罚款等行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明：该股票根据公司个股入库程序进入备选池，并由研究员定期跟踪及分析，本基金管理人已较长时间跟踪该股票，并看好其投资价值。五粮液公司受证监会处罚一事公告当日，本基金管理人即启动风控程序将其纳入禁止池。此后，经过行业研究员进一步了解和分析，认为此次处罚基本针对历史事件展开，立案调查已有结论，对公司的业务无实质性的影响，同时对财务状况和现金流量也不会产生重大质性影响，并且促进了公司治理的改善。该事件不改变本基金管理人对五粮液投资价值的判断。经过投资决策委员会批准，该个股重新纳入备选池。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 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。

7.9.3 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	2,594,721.65
2	应收证券清算款	3,818,786.14
3	应收股利	25,200.00
4	应收利息	352,564.39
5	应收申购款	178,426.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,969,699.03

7.9.4 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。

7.9.5 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不存在流通受限情况。

8基金份额持有人信息

8.1 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
6,467	49,210.76	14,975,289.56	4.71%	303,270,711.39	95.29%

8.2 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	5,643,607.47	1.77%

9开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月28日）基金份额总额	363,570,378.53
本报告期期初基金份额总额	326,396,093.99
本报告期基金总申购份额	84,275,880.99
减：本报告期基金总赎回份额	92,425,974.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	318,246,000.95

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额

10重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。本基金管理人于2011年7月21日发布公告：因工作调动，经股东会和董事会分别审议决定，同意李格平先生自2011年7月1日起辞去董事职务和董事长职务；本基金管理人董事会同时选举公司董事、总经理杨忆风自2011年7月1日起代行董事长职务，代为履行董事长职务的时间不得超过90日。中国证监会对杨忆风代为履行董事长职务事宜进行了审查并已出具无异议函（基金部函［2011］536号）。

（2）本基金托管人的基金托管部门的重大人士变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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2011年度的基金审计机构。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一年的审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内，本基金的基金管理人、本基金托管人及高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	606,517,166.06	20.98%	492,799.07	20.49%	-
中信证券	1	500,667,816.66	17.32%	406,795.89	16.91%	-
国泰君安证券	2	273,631,050.79	9.46%	232,585.82	9.67%	-
申银万国证券	1	243,244,625.81	8.41%	206,757.45	8.60%	-
东方证券	2	364,128,096.90	12.59%	305,084.21	12.68%	-
国信证券	2	353,810,011.19	12.24%	300,736.52	12.50%	-
海通证券	1	190,454,193.76	6.59%	161,884.75	6.73%	-
安信证券	2	30,101,707.90	1.04%	25,586.01	1.06%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	160,526,597.55	5.55%	136,448.30	5.67%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	168,417,957.12	5.82%	136,840.22	5.69%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
合计	18	2,891,499,223.74	100.00%	2,405,518.24	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席位：申银万国证券股份有限公司1个、光大证券有限公司1个、东兴证券股份有限公司1个。

10.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	174,500,000.00	15.84%	-	-
申银万国证券	17,263,313.70	100.00%	23,700,000.00	2.15%	-	-
东方证券	-	-	315,600,000.00	28.64%	-	-
国信证券	-	-	214,000,000.00	19.42%	-	-
海通证券	-	-	96,000,000.00	8.71%	-	-
安信证券	-	-	90,000,000.00	8.17%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	188,000,000.00	17.06%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
合计	17,263,313.70	100.00%	1,101,800,000.00	100.00%	-	-

11影响投资者决策的其他重要信息

2011年6月28日，本基金管理人发布关于变更诺德中小盘股票型证券投资基金业绩比较基准并相应修改基金合同的公告，自2011年7月1日起，本基金的业绩比较基准由"天相中盘指数×40%+天相小盘指数×40%+上证国债指数×20%"变更为："中证700指数×80%+上证国债指数×20%"。

诺德基金管理有限公司
二〇一一年八月二十五日