# 诺德增强收益债券型证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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 | 诺德增强收益债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 诺德增强收益债券 |
| 基金主代码 | 573003 |
| 交易代码 | 573003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年3月4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 | 59,365,527.55份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为主动式管理的债券型基金，主要通过全面投资于各类债券品种，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，为基金份额持有人获得较好的全面投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系，形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期，并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析，综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素，主动构建和调整投资组合，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资收益的目的。本基金对非债券产品的直接投资首选在一级市场上的新股申购（含增发），如果新股的收益率降低，根据风险和收益的配比原则，本基金将参与二级市场的股票买卖。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数（全价）收益率*90%+沪深300指数收益率*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金 |

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 | 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 |

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 | -362,662.25 |
| 本期利润 | -927,894.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0150 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.44% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.00% |
| 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 | 1,751,348.25 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0295 |
| 期末基金资产净值 | 61,116,875.80 |
| 期末基金份额净值 | 1.030 |
| 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 | 5.73% |

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 | 0.00% | 0.33% | -0.55% | 0.17% | 0.55% | 0.16% |
| 过去三个月 | -0.87% | 0.30% | -1.00% | 0.13% | 0.13% | 0.17% |
| 过去六个月 | -2.00% | 0.34% | -0.58% | 0.15% | -1.42% | 0.19% |
| 过去一年 | 4.48% | 0.38% | -1.03% | 0.17% | 5.51% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.73% | 0.33% | 1.01% | 0.19% | 4.72% | 0.14% |

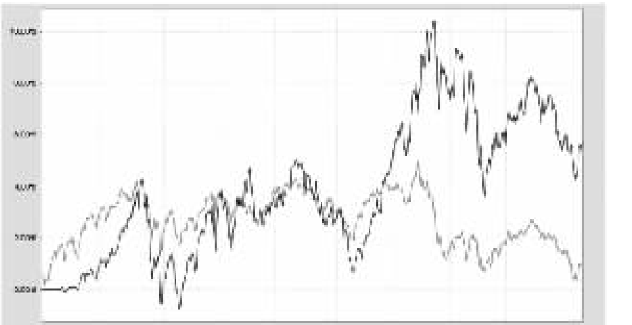
注：业绩比较基准=中国债券总指数（全价）收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

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

诺德增强收益债券型证券投资基金

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

（2009年3月4日至2011年6月30日）



注：诺德增强收益债券型证券投资基金成立于2009年3月4日，图示时间段为2009年3月4日至2011年6月30日。

本基金建仓期间自2009年3月4日至2009年9月3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 | | |
| 张辉 | 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 | 2010-06-23 | - | 14年 | 纽约大学(New York University)工商管理硕士(MBA)。1994年起历任美国JP摩根(JP Morgan)高级经理，美国高盛(Goldman Sachs)副总裁等职。2007年9月加入诺德基金管理有限公司，先后担任公司投资研究部行业研究员，基金经理助理等职务。现担任本基金基金经理和诺德优选30股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格和特许金融分析师(CFA)资格。 |
| 赵滔滔 | 本基金基金经理 | 2010-06-23 | - | 4年 | 上海财经大学金融学硕士。2006年11月至2008年10月，任职于平安资产管理有限责任公司。2008年10月加入诺德基金管理有限公司，担任债券交易员，固定收益研究员等职务。具有基金从业资格。 |

注：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，不存在与诺德增强收益债券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股票型基金和混合型基金，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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。

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

今年以来债券市场环境发生了较大的不利变化。通胀水平（CPI）逐步攀升，6月份已经突破6%，创下本轮通胀周期的新高，央行3次提高基准利率，同时存款准备金率逐月上调，并已创下历史新高。今年以来存准率连续上调的边际紧缩效应显现，债市资金面异常紧张，6月以来资金利率持续维持高位。在不断走高的通胀和资金面趋紧的压力下，上半年的债券市场先扬后抑，大幅重挫，各品种收益率水平均大幅上升，中债总指数最低点已回到去年年底的较低水平。

年初，基于本轮加息周期进入后半程的判断，在权衡宏观调控的节奏和债券息差保护的基础上，本基金采取了积极的资产配置策略，重点配置了高票息、流动性较佳的信用债，并适度使用杠杆进行增厚，获得较好收益。此策略延续至2季度。从5月份下旬开始，存准率明显超调的边际效应显现，再加上商业银行体系年中考核引发的资金需求冲击，导致债市资金面急剧恶化，债市转头向下。在市场环境恶化的情况下，本基金采取了去杠杆和降低仓位策略，回避了部分损失。可转债投资方面，本基金保持了对流动性好、估值水平较低的可转债的重点配置，但在2季度末的债市调整中，可转债资产也造成了一定程度的损失。另外，基于新股申购收益与风险水平不匹配的判断，本基金未参与新股一级市场的网下申购。

上半年股市震荡向下，中小盘明显跑输低估值大盘及周期板块。随着经济下滑和通胀的逐步高企，受益通胀与一些供给产能受控的子行业表现较好。本基金的股票配置基本维持基准仓位以上，从年初的偏重中小盘逐步转向周期类，同时着重配置业绩较确定特别是中报有望超预期的个股。

报告期内，本基金跑输业绩基准的主要原因是权益部分资产（股票及可转债）仓位较重，导致损失较大。

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1.030元，累计份额净值为1.057元，本报告期份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准增长率为-0.58%。

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，通货膨胀可能在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。严控货币信贷紧缩政策的持续将导致整个市场资金面偏紧且脆弱。因此，我们预计下半年债市的表现也将难以大幅提升，市场将维持振荡格局。

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，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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德增强收益债券型证券投资基金

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<br>2011年6月30日 | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 158,346.49 | 217,978.93 |
| 结算备付金 | | 327,747.46 | 2,516,876.97 |
| 存出保证金 | | 250,000.00 | 291,821.24 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 56,423,735.70 | 54,385,814.93 |
| 其中：股票投资 | | 11,583,524.20 | 9,450,830.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 44,840,211.50 | 44,934,984.93 |
| 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 | 4,700,000.00 | 6,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 928,970.13 | 3,719,819.62 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,128,170.18 | 715,401.35 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 300,200.00 | 23,581.58 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 64,217,169.96 | 67,871,294.62 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2011年6月30日 | 上年度末<br>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 | | 2,200,000.00 | 3,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 2,919,863.38 |
| 应付赎回款 | | 154,898.15 | 6,651.96 |
| 应付管理人报酬 | | 37,798.84 | 40,851.77 |
| 应付托管费 | | 10,079.69 | 10,893.79 |
| 应付销售服务费 | | 20,159.40 | 21,787.56 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 28,402.95 | 137,389.46 |
| 应交税费 | | 475,184.68 | 468,784.68 |
| 应付利息 | | 207.30 | 1,339.59 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 173,563.15 | 390,000.29 |
| 负债合计 | | 3,100,294.16 | 6,997,562.48 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 59,365,527.55 | 57,915,842.18 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,751,348.25 | 2,957,889.96 |
| 所有者权益合计 | | 61,116,875.80 | 60,873,732.14 |
| 负债和所有者权益总计 | | 64,217,169.96 | 67,871,294.62 |

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值1.030元，基金份额总额59,365,527.55份。

6.2 利润表

会计主体：诺德增强收益债券型证券投资基金

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 56,772.78 | 162,739.83 |
| 1.利息收入 | 6.4.7.11 | 1,155,182.13 | 1,037,543.86 |
| 其中：存款利息收入 | | 16,521.68 | 46,638.00 |
| 债券利息收入 | | 1,056,299.21 | 920,309.31 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 82,361.24 | 70,596.55 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以"-"填列） | | -544,701.47 | 1,084,977.85 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -494,250.40 | 1,404,402.85 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -115,715.57 | -347,999.84 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 65,264.50 | 28,574.84 |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | 6.4.7.16 | -565,232.40 | -1,959,988.04 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | 6.4.7.17 | 11,524.52 | 206.16 |
| 减：二、费用 | | 984,667.43 | 1,650,456.64 |
| 1.管理人报酬 | | 239,034.64 | 309,079.09 |
| 2.托管费 | | 63,742.55 | 82,421.09 |
| 3.销售服务费 | | 127,485.14 | 164,842.20 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.18 | 263,186.67 | 789,981.97 |
| 5.利息支出 | | 106,154.49 | 87,895.62 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 106,154.49 | 87,895.62 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.19 | 185,063.94 | 216,236.67 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | | -927,894.65 | -1,487,716.81 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | | -927,894.65 | -1,487,716.81 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德增强收益债券型证券投资基金

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<br>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） | 57,915,842.18 | 2,957,889.96 | 60,873,732.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -927,894.65 | -927,894.65 |
| 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） | 1,449,685.37 | -278,647.06 | 1,171,038.31 |
| 其中：1.基金申购款 | 60,905,918.25 | 2,312,215.24 | 63,218,133.49 |
| 2.基金赎回款 | -59,456,232.88 | -2,590,862.30 | -62,047,095.18 |
| 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） | 59,365,527.55 | 1,751,348.25 | 61,116,875.80 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2010年1月1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） | 109,528,242.98 | 3,910,850.50 | 113,439,093.48 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -1,487,716.81 | -1,487,716.81 |
| 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） | -44,047,545.03 | -1,636,522.93 | -45,684,067.96 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,675,849.94 | 62,594.67 | 1,738,444.61 |
| 2.基金赎回款 | -45,723,394.97 | -1,699,117.60 | -47,422,512.57 |
| 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） | 65,480,697.95 | 786,610.76 | 66,267,308.71 |

注：

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

诺德增强收益债券型证券投资基金（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1392号《关于核准诺德增强收益债券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《诺德增强收益债券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1,184,234,685.11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021号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》于2009年3月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,184,890,833.63份基金份额，其中认购资金利息折合656,148.52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《诺德增强收益债券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及交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券和债券回购等固定收益证券品种，以及股票、权证等权益类证券品种。本基金的投资组合比例为：债券类（包括可转债）资产的投资比例为基金资产净值的80%-95%，本基金持有的非债类资产为基金资产净值的0%-20%；基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券（包括央行票据）的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：90% X 中国债券总指数（全价）收益率+10% X 沪深300指数收益率。

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》、《诺德增强收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

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

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。

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2010年1月1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 | - | - | 55,223,984.20 | 10.79% |

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 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 长江证券 | - | - | 35,106,547.15 | 7.99% |

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010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 | 46,223.29 | 10.77% | 46,223.29 | 10.77% |

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 239,034.64 | 309,079.09 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 28,047.02 | 40,458.90 |

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0.75%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 0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 63,742.55 | 82,421.09 |

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0.2%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 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 建设银行 | 96,813.09 |
| 长江证券 | 847.95 |
| 诺德基金管理有限公司 | 2,501.26 |
| 合计 | 100,162.30 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 建设银行 | 159,295.02 |
| 长江证券 | 123.16 |
| 诺德基金管理有限公司 | 2,409.54 |
| 合计 | 161,827.72 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给诺德基金管理有限公司，再由诺德基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.4 % / 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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 9,680,542.11 | - |
| 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 | 9,680,542.11 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 16.31% | - |

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2010年1月1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 |
| 中国建设银行 | 158,346.49 | 9,504.10 | 1,920,554.98 | 29,676.54 |

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。

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

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000876 | 新希望 | 2011-06-29 | 资产重组 | 19.95 | 2011-07-05 | 21.95 | 12,000 | 226,480.00 | 239,400.00 | - |

注：本基金截至2011年6月30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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,200,000.00元，于2011年7月14日、2011年7月28日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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 | 11,583,524.20 | 18.04 |
| | 其中：股票 | 11,583,524.20 | 18.04 |
| 2 | 固定收益投资 | 44,840,211.50 | 69.83 |
| | 其中：债券 | 44,840,211.50 | 69.83 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 4,700,000.00 | 7.32 |
| | 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 | 486,093.95 | 0.76 |
| 6 | 其他各项资产 | 2,607,340.31 | 4.06 |
| 7 | 合计 | 64,217,169.96 | 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 | 162,100.00 | 0.27 |
| B | 采掘业 | 1,572,961.00 | 2.57 |
| C | 制造业 | 6,508,511.20 | 10.65 |
| C0 | 食品、饮料 | 1,259,420.00 | 2.06 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 409,000.00 | 0.67 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | 253,800.00 | 0.42 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,957,610.00 | 3.20 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,759,886.20 | 2.88 |
| C8 | 医药、生物制品 | 868,795.00 | 1.42 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 267,072.00 | 0.44 |
| E | 建筑业 | 1,169,400.00 | 1.91 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 610,640.00 | 1.00 |
| H | 批发和零售贸易 | 191,520.00 | 0.31 |
| I | 金融、保险业 | 405,120.00 | 0.66 |
| J | 房地产业 | 514,200.00 | 0.84 |
| K | 社会服务业 | 182,000.00 | 0.30 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 11,583,524.20 | 18.95 |

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 | 002006 | 精功科技 | 10,000 | 574,100.00 | 0.94 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 20,000 | 555,200.00 | 0.91 |
| 3 | 600111 | 包钢稀土 | 7,000 | 500,010.00 | 0.82 |
| 4 | 000063 | 中兴通讯 | 13,000 | 367,640.00 | 0.60 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 12,000 | 361,680.00 | 0.59 |
| 6 | 600123 | 兰花科创 | 7,950 | 332,151.00 | 0.54 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 30,000 | 329,700.00 | 0.54 |
| 8 | 002081 | 金螳螂 | 8,000 | 321,600.00 | 0.53 |
| 9 | 600188 | 兖州煤业 | 9,000 | 317,700.00 | 0.52 |
| 10 | 600801 | 华新水泥 | 12,000 | 307,200.00 | 0.50 |

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 | 600801 | 华新水泥 | 2,022,805.20 | 3.32 |
| 2 | 600496 | 精工钢构 | 1,920,839.78 | 3.16 |
| 3 | 600585 | 海螺水泥 | 1,828,095.61 | 3.00 |
| 4 | 002106 | 莱宝高科 | 1,536,632.00 | 2.52 |
| 5 | 000937 | 冀中能源 | 1,478,074.42 | 2.43 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 1,463,120.00 | 2.40 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 1,462,807.00 | 2.40 |
| 8 | 600366 | 宁波韵升 | 1,433,752.00 | 2.36 |
| 9 | 600252 | 中恒集团 | 1,427,033.25 | 2.34 |
| 10 | 002006 | 精功科技 | 1,288,026.16 | 2.12 |
| 11 | 002244 | 滨江集团 | 1,208,799.35 | 1.99 |
| 12 | 000968 | 煤气化 | 1,117,486.80 | 1.84 |
| 13 | 600395 | 盘江股份 | 1,075,228.00 | 1.77 |
| 14 | 600031 | 三一重工 | 1,053,970.00 | 1.73 |
| 15 | 600537 | 海通集团 | 1,040,052.00 | 1.71 |
| 16 | 000876 | 新希望 | 1,027,737.24 | 1.69 |
| 17 | 000568 | 泸州老窖 | 1,006,350.00 | 1.65 |
| 18 | 000009 | 中国宝安 | 957,910.44 | 1.57 |
| 19 | 600549 | 厦门钨业 | 933,781.50 | 1.53 |
| 20 | 000630 | 铜陵有色 | 933,775.00 | 1.53 |

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 | 600801 | 华新水泥 | 2,071,419.81 | 3.40 |
| 2 | 600366 | 宁波韵升 | 1,789,069.40 | 2.94 |
| 3 | 600585 | 海螺水泥 | 1,764,882.45 | 2.90 |
| 4 | 002106 | 莱宝高科 | 1,757,062.92 | 2.89 |
| 5 | 600496 | 精工钢构 | 1,701,387.99 | 2.79 |
| 6 | 000937 | 冀中能源 | 1,572,978.00 | 2.58 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 1,533,751.00 | 2.52 |
| 8 | 000039 | 中集集团 | 1,315,577.00 | 2.16 |
| 9 | 600395 | 盘江股份 | 1,302,768.00 | 2.14 |
| 10 | 002069 | 獐子岛 | 1,167,597.00 | 1.92 |
| 11 | 600252 | 中恒集团 | 1,135,793.42 | 1.87 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 1,126,934.99 | 1.85 |
| 13 | 000968 | 煤气化 | 1,062,859.99 | 1.75 |
| 14 | 002244 | 滨江集团 | 1,027,098.00 | 1.69 |
| 15 | 600362 | 江西铜业 | 1,008,622.00 | 1.66 |
| 16 | 000009 | 中国宝安 | 966,326.28 | 1.59 |
| 17 | 600644 | 乐山电力 | 956,085.00 | 1.57 |
| 18 | 600354 | 敦煌种业 | 936,793.00 | 1.54 |
| 19 | 601808 | 中海油服 | 926,302.00 | 1.52 |
| 20 | 600111 | 包钢稀土 | 914,642.00 | 1.50 |

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

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 87,609,226.70 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 84,723,443.10 |

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 | 3,686,350.00 | 6.03 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 31,315,514.10 | 51.24 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 9,838,347.40 | 16.10 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 44,840,211.50 | 73.37 |

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 | 113002 | 工行转债 | 45,170 | 5,351,289.90 | 8.76 |
| 2 | 122033 | 09富力债 | 42,370 | 4,420,885.80 | 7.23 |
| 3 | 111047 | 08长兴债 | 36,770 | 3,867,836.30 | 6.33 |
| 4 | 112016 | 09宏润债 | 33,544 | 3,448,323.20 | 5.64 |
| 5 | 010112 | 21国债⑿ | 32,000 | 3,192,000.00 | 5.22 |

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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。

7.9.2 本基金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 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 928,970.13 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,128,170.18 |
| 5 | 应收申购款 | 300,200.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,607,340.31 |

7.9.4 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 | 113002 | 工行转债 | 5,351,289.90 | 8.76 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 2,533,920.00 | 4.15 |
| 3 | 110007 | 博汇转债 | 194,192.50 | 0.32 |
| 4 | 110003 | 新钢转债 | 173,550.00 | 0.28 |

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 |
| 1,065 | 55,742.28 | 9,680,542.11 | 16.31% | 49,684,985.44 | 83.69% |

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 | 514,278.02 | 0.87% |

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2009年3月4日）基金份额总额 | 1,184,890,833.63 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 57,915,842.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 60,905,918.25 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 59,456,232.88 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 59,365,527.55 |

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）本报告期内，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。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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、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。普华永道中天会计师事务所有限公司担任过本基金募集的验资机构，提供过相关服务。

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。

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 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | 1 | 27,351,568.38 | 15.89% | 22,223.57 | 15.50% | - |
| 中信建投证券 | 1 | 28,256,071.14 | 16.41% | 24,017.54 | 16.75% | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 4,259,268.42 | 2.47% | 3,620.36 | 2.53% | - |
| 申银万国证券 | 1 | 15,072,651.88 | 8.76% | 12,811.62 | 8.94% | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | 43,817,749.69 | 25.45% | 37,244.86 | 25.98% | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | 51,613,571.89 | 29.98% | 41,936.51 | 29.25% | - |
| 齐鲁证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | 1,772,088.40 | 1.03% | 1,506.20 | 1.05% | - |
| 合计 | 34 | 172,142,969.80 | 100.00% | 143,360.66 | 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未新租用基金专用交易单元。

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 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | 34,508,938.92 | 11.32% | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 47,298,091.31 | 15.52% | 174,100,000.00 | 30.07% | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 8,270,327.46 | 2.71% | 30,700,000.00 | 5.30% | - | - |
| 申银万国证券 | 44,220,474.94 | 14.51% | 65,700,000.00 | 11.35% | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 100,098,656.10 | 32.84% | 271,800,000.00 | 46.94% | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 43,720,058.56 | 14.34% | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1,129,872.71 | 0.37% | 5,400,000.00 | 0.93% | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 25,543,480.58 | 8.38% | 31,300,000.00 | 5.41% | - | - |
| 合计 | 304,789,900.58 | 100.00% | 579,000,000.00 | 100.00% | - | - |

**诺德基金管理有限公司**
**二〇一一年八月二十五日**