诺德深证300指数分级证券投资基金招募说明书

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

二〇一二年七月

【重要提示】

诺德深证300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会2012年4月25日证监许可【2012】551号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的波动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《诺德深证300指数分级证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了诺德深证300指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指诺德深证300指数分级证券投资基金；
基金合同：	指《诺德深证300指数分级证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《诺德深证300指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议：	指《诺德深证300指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
上市交易公告书：	指《诺德深证300指数分级证券投资基金之深证300A份额与深证300B份额上市交易公告书》；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《反洗钱法》	指2006年10月31日经第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议通过，自2007年1月1日起实施的《中华人民共和国反洗钱法》及颁布机关对其不时作出的修订；
《销售办法》：	指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指诺德基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指诺德基金管理有限公司或接受诺德基金管理有限公司委托的其他符合条件的办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会：	指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人赎回本基金基金份额的行为；
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为，包括跨系统转托管和系统内转托管；
定期定额投资计划：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；
指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，以及具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
封闭期：	指基金合同生效后不办理申购、赎回的工作日，最长不超过自基金合同生效之日起三个月。
折算基准日	基金份额定期折算：折算基准日为每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外） 基金份额不定期折算：当诺德深证300份额的基金份额净值达到2.000元或诺德深证300B份额的基金份额参考净值达到0.250元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本节约和费用的节约；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和诺德深证300份额净值、诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等；
诺德深证300份额：	本基金的基础份额。投资者在场外认申购的诺德深证300份额不进行基金份额分拆；投资者在场内认购的诺德深证300份额将自动进行基金份额分离；投资者在场内申购的诺德深证300份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆；
诺德深证300A份额：	本基金基础份额按《基金合同》约定规则所分离的稳健收益类基金份额；
诺德深证300B份额：	本基金基础份额按《基金合同》约定规则所分离的积极收益类基金份额；
诺德深证300A份额的本金：	除非《基金合同》文义另有所指，对于诺德深证300A份额而言，指1.000元；
场外：	通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；
场内：	通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；
注册登记系统：	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统；
证券登记结算系统：	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统；
上市交易：	基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖诺德深证300A份额、诺德深证300B份额的行为；
系统内转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为；
自动分离：	指投资者在场内认购的每两份诺德深证300份额在发售结束后按1∶1比例自动转换为一份诺德深证300A份额和一份诺德深证300B份额的行为；
配对转换：	指本基金的诺德深证300份额与诺德深证300A份额、诺德深证300B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并；
分拆：	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每两份诺德深证300份额的场内份额申请转换成一份诺德深证300A份额与一份诺德深证300B份额的行为；
合并：	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每一份诺德深证300A份额与一份诺德深证300B份额申请转换成两份诺德深证300份额的场内份额的行为；
诺德深证300A份额约定年基准收益率：	本基金为每份诺德深证300A份额所设定的每年应获得的收益率，诺德深证300A份额约定年基准收益率为1年期同期银行定期存款利率（税后）×3%，1年期同期银行定期存款利率以当年1月1日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为（基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）×3%）；
诺德深证300A份额约定年应得收益：	诺德深证300A份额在每个会计年度的应获得的约定基准收益，但基金管理人并不承诺或保证诺德深证300A份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，诺德深证300A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险；
诺德深证300A份额约定日应得收益：	依据诺德深证300A份额约定年基准收益率计算的每日收益；
诺德深证300B份额应得资产及收益：	在每个会计年度期末，本基金净资产优先分配予诺德深证300A份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产；虽然本基金设定了不定期折算条款，以避免诺德深证300B份额因市场波动过大所面临的风险，但在某些极端损失情况下，诺德深证300B份额的基金份额持有人可能面临投资本金大幅亏损甚至为零的风险。
标的指数：	深证300价格指数。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人：诺德基金管理有限公司
住所：上海市浦东陆家嘴环路1233号汇亚大厦12楼
办公地址：上海市浦东陆家嘴环路1233号汇亚大厦12楼
邮政编码：200120
法定代表人：杨忆风
成立日期：2006年6月8日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：证监基金字[2006]88号
经营范围：基金管理业务；募集、发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：壹亿元人民币
联系人：张 欣
联系电话：021-68879999
股权结构：

Lord, Abbett & Co.LLC	49%
长江证券有限责任公司	30%
清华控股有限公司	21%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员：

杨忆风先生，董事长，清华大学学士，美国University of Wisconsin-Madison电子材料与器件博士，金融学硕士。曾在美国多家金融机构任职，包括General Re Asset Management，J&W Seligman & Co.，Vantage Investment Advisors，Munder Capital Management，Lord，Abbett & Co. LLC，历任分析师，基金经理，资深基金经理，研究主管，资深投资顾问和董事经理；诺德基金管理有限公司成立后曾担任董事、总经理职务。

Zane E Brown先生，董事。国籍：美国，美国Clarion大学管理和市场营销学士，科罗拉多州立大学MBA，现任LORD ABBETT高级合伙人，历任Equitable资产管理公司执行副总裁，Brown Brothers Harriman公司的高级投资经理等职。

董继发先生，董事，中南财经政法大学硕士研究生毕业，现任长江证券股份有限公司副总裁、长江期货有限公司董事长。董继发先生之前曾先后担任长江证券股份有限公司经纪业务总部副总经理、营运管理总部主管等职务。

宋军先生，董事，清华大学工程力学学士、硕士、博士，现为清华大学教育基金会副理事长兼秘书长，历任清华大学副教授、清华大学科技开发部主任、清华控股有限公司董事长等职。

潘福祥先生，董事，总经理，清华大学学士、硕士，中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券总部副总经理和清华兴业投资管理有限公司总经理，清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授，诺德基金管理有限公司董事、副总经理。

马莉女士，董事，武汉大学金融学院硕士、EMBA，现任长江证券有限责任公司副总裁、研究所所长，历任长江证券债券事务部总经理、长江证券总裁助理等职。

张文娟女士，董事，管理学硕士、高级会计师。现任清华控股有限公司副总裁，兼任紫光股份有限公司监事、紫光集团有限公司董事、清华大学出版社有限公司监事会主席等职务，曾任清华大学财务处处长助理、副处长等职务。

史丹女士，独立董事，华中科技大学管理学院博士，现任中国社会科学院工经所研究员，曾任华北电力大学管理系讲师。

陈志武先生，独立董事，国籍：美国，国防科技大学硕士，美国耶鲁大学金融经济学博士，现任耶鲁大学金融教学与研究教授、Zebra Capital management基金合伙人，曾任Ohio State University金融教学与研究副教授。

郭峰先生，独立董事，中国人民大学法学院硕士、博士，中央财经大学法学院教授，曾任中国人民大学法学院讲师、副教授。

梁猷能先生，独立董事，清华大学工程物理系学士，曾任清华大学校副校长、国家会计学院院长等职。

2、基金管理人监事会成员：

李汉生先生，监事，国籍：中国澳门。香港大学计算机技术与应用数学专业学士，现任和勤软件技术有限公司董事长兼CEO，曾任惠普中国区副总裁和万正数码公司总裁。

秦蓮先生，监事，中国人民大学MBA，现任清华控股有限公司资产管理中心主任，历任清华控股有限公司资产运营部高级经理、财务部副部长、财务部部长。

熊雷鸣先生，监事，中南财经大学会计系硕士，现任长江证券有限责任公司财务总部副总经理，历任财务总部副经理、经理。

崔晓妮女士，监事，华中理工大学学士，现任诺德基金管理有限公司运营总监，曾任职于华安基金管理有限公司。

陈国光先生，监事，清华大学工商管理硕士，现任诺德基金管理有限公司基金经理，曾任清华兴业投资管理有限公司研究员。

3、公司高级管理人员：

杨忆风先生，董事长，清华大学学士，美国University of Wisconsin-Madison电子材料与器件博士，金融学硕士。曾在美国多家金融机构任职，包括General Re Asset Management，J&W Seligman & Co.，Vantage Investment Advisors，Munder Capital Management，Lord，Abbett & Co. LLC，历任分析师，基金经理，资深基金经理，研究主管，资深投资顾问和董事经理；诺德基金管理有限公司成立后曾担任董事、总经理职务。

潘福祥先生，董事，总经理。清华大学学士、硕士，中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券总部副总经理和清华兴业投资管理有限公司总经理，清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授，诺德基金管理有限公司董事、副总经理。

张炳先生，督察长，清华大学学士，美国Wayne State University经济学硕士，New York University 工商管理硕士，曾任美国AllianceBernstein L.P.固定收益研究部副总裁、MONY Capital Management，Inc.董事投资经理和Moody's Investors Service分析师。

4、本基金基金经理

薛珠女士，上海财经大学金融数学与金融工程硕士，华东理工大学数学与应用数学学士，2007年3月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风险控制部助理研究员、投资研究部研究员、高级研究员，现任诺德价值优势股票型证券投资基金基金经理、数量研究主管。薛珠女士具有基金从业资格。

5、投资决策委员会成员

公司总经理潘福祥先生、投资总监胡志伟先生、研究副总监周勇先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

6、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

7、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

8、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

9、依法接受基金托管人的监督；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

（下转D18版）

诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额发售公告

公告日期：2012年7月27日

重要提示

1、诺德深证300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监基金字【2012】551号文批准。

2、本基金是契约型开放式证券投资基金。

3、本基金的管理人为诺德基金管理有限公司（以下简称“本公司”），托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金的发售期为2012年08月01日起至2012年08月31日，投资者可通过场外认购和场内认购两种方式认购本基金。本基金通过场外发售的销售机构包括本公司的直销中心和中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）、中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）、交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）、长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）、国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）、兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）、中信证券（浙江）有限责任公司（以下简称“中信证券（浙江）”）、平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）、海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）、中航证券有限公司（以下简称“中航证券”）、齐鲁证券有限公司（简称“齐鲁证券”）、天相投资顾问有限公司（以下简称“天相投顾”）、安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）、厦门证券有限公司（以下简称“厦门证券”）、华安证券有限责任公司（以下简称“华安证券”）、中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）、华福证券有限责任公司（以下简称“华福证券”）、东海证券有限责任公司（以下简称“东海证券”）、信达证券股份有限公司（以下简称“信达证券”）、中信万通证券有限责任公司（以下简称“中信万通”）、广州证券有限责任公司（以下简称“广州证券”）、招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）、中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）、上海证券有限责任公司（以下简称“上海证券”）、民生证券有限责任公司（以下简称“民生证券”）等代销机构。本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（经建设证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西南证券、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券，具体名单以深圳证券交易所网站查询结果为准）。

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等等，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

5、本基金募集对象包括中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外），以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（七）募集时间安排与基金合同生效

1、本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过3个月。

2、本基金自2012年08月01日到2012年08月31日公开发售。在上述时间段内，本基金向个人投资者和机构投资者同时发售。基金管理人根据认购的情况可适当延长发售时间，但最长不超过法定募集期限。

3、自基金份额发售之日起3个月内，如果本基金的募集份额总额不少于2亿份、募集金额不少于2亿元人民币，且认购户数不少于200人，则本基金基金合同满足生效条件。

本基金基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入专用账户，不作它用。

4、基金管理人办理完毕基金备案手续后，基金合同生效，认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

5、若3个月的募集期满，本基金合同未达到法定生效条件，则本基金合同不能生效，本基金管理人将承担全部募集费用，并将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后30天内退还基金投资者。

二、认购方式与相关规定

募集期间，投资者可通过场外、场内两种方式认购本基金。

（一）基金份额的场外认购

1、认购方式

本基金的场外认购采用全额缴款、金额认购的方式。

2、场外认购费率

认购费用由基金管理人和代销机构收取，将被用来支付销售代理费、材料制作费、营销宣传费等与销售活动有关的开支，不列入基金资产。

场外认购费率：

认购金额（元）	认购费率
50 万以下	1.0%
50万（含）-200 万	0.6%
200万（含）- 500万	0.3%
500 万（含）以上	收取固定费用1000元/笔

投资者重复认购，须按照每次认购金额所对应的费率档次分别计费。

场外认购费用及认购份数的计算方法如下：

净认购金额=认购金额 / (1+认购费率)

（注：对于适用固定金额认购费的认购，净认购金额=认购金额-固定认购费金额）

认购费用=认购金额-净认购金额

（注：对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

认购份额= (净认购金额+认购金额产生的利息)/基金份额初始面值

本基金的场外认购份额为每份基金份额1.00元人民币。本基金发售结束后，投资者通过场外认购本基金所获得的全部份额将确认为诺德深证300 份额。

场外认购份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分采取截位法，由此产生的误差计入基金财产。

例一：假定某投资者投资100,000元场外认购本基金，认购金额在募集期产生的利息为30元。则其可得到的认购份额计算如下：

净认购金额=100,000 / (1+1%)=99,009.90元

认购费用=100,000-99,009.90=990.10元

认购份额= 99,009.90+30 /1.00=99,039.90份

即投资者投资100,000元通过场外认购本基金，基金成立后可得到99,039.90份诺德深证300份额（含利息折份额部分）。

3、在募集期内，投资者通过场外的代销机构首次认购本基金的单笔最低金额为人民币50,000元（含认购费），追加认购金额每笔不低于人民币50,000元（含认购费），投资者通过基金管理人的直销中心首次认购本基金的单笔最低金额为人民币50,000元（含认购费）。本基金募集期内对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。

本基金场内认购采用份额认购的方式，投资者通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000 份，超过50,000 份的须是1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不得超过99,999,000 份。本基金募集期内对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

9、《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在基金募集期间产生的利息将折合成基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

10、销售网点（包括直销网点和代销网点）或网上交易渠道受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表确实收到了认购申请。认购申请是否有效应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后第2个工作日起到各销售网点或通过网上交易系统查询最终成交确认情况和认购的份额。

11、本公告仅对“诺德深证300指数分级证券投资基金”发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解详细情况，请详细阅读刊登在2012年7月27日《中国证券报》、《上海证券报》以及《证券时报》上的《诺德深证300指数分级证券投资基金招募说明书》。

12、本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（www.lordabbettchina.com）上。投资者亦可通过网站下载基金申请表格和了解基金发售相关事宜。

13、各代销机构代销网点及开户、认购等事项的详细情况请向各代销机构咨询。投资者也可拨打本公司客户服务电话（400-888-0009、021-68604888），中国银行客服电话（95566）及其他代销机构客户服务电话咨询购买事宜。

14、对未开设销售网点的地区的投资者，请拨打本公司的客户服务电话（400-888-0009、021-68604888）咨询购买事宜。

15、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

一、本次发售基金基本情况

（一）基金名称

诺德深证300指数分级证券投资基金。（基金代码：165707）

基金简称：诺德深证300指数分级

场内简称：诺德S300

（二）基金运作方式和类型

契约型开放式、股票型

（三）基金存续期限

不定期

（四）基金份额面值

每份基金份额初始面值为1.00元人民币

（五）募集目标

本基金不设募集规模的上限。

（六）投售对象

包括中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外），以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（七）募集时间安排与基金合同生效

1、诺德深证300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监基金字【2012】551号文批准。

2、本基金是契约型开放式证券投资基金。

3、本基金的管理人为诺德基金管理有限公司（以下简称“本公司”），托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金的发售期为2012年08月01日起至2012年08月31日，投资者可通过场外认购和场内认购两种方式认购本基金。本基金通过场外发售的销售机构包括本公司的直销中心和中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）、中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）、交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）、长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）、国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）、兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）、中信证券（浙江）有限责任公司（以下简称“中信证券（浙江）”）、平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）、海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）、中航证券有限公司（以下简称“中航证券”）、齐鲁证券有限公司（简称“齐鲁证券”）、天相投资顾问有限公司（以下简称“天相投顾”）、安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）、厦门证券有限公司（以下简称“厦门证券”）、华安证券有限责任公司（以下简称“华安证券”）、中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）、华福证券有限责任公司（以下简称“华福证券”）、东海证券有限责任公司（以下简称“东海证券”）、信达证券股份有限公司（以下简称“信达证券”）、中信万通证券有限责任公司（以下简称“中信万通”）、广州证券有限责任公司（以下简称“广州证券”）、招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）、中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）、上海证券有限责任公司（以下简称“上海证券”）、民生证券有限责任公司（以下简称“民生证券”）等代销机构。本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（经建设证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西南证券、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券，具体名单以深圳证券交易所网站查询结果为准）。

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中特定风险等等，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

5、本基金募集对象包括中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金者除外），以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

6、募集期内投资者欲通过场外认购本基金，需开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。若已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户，则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销中心和指定的基金销售代理机构点同时为投资者办理场外认购的开户和认购手续。

投资者欲通过场内认购本基金，应使用深圳证券交易所A股账户或基金账户，已有该类账户的投资者不须另行开立。募集期内具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可同时为投资者办理场内认购的开户和认购手续。

7、募集期内，投资者可对本基金进行多次认购，认购申请一旦被受理，即不得撤销。投资者应保证用于认购的资金来源合法，有权自行支配，且不存在任何法律上的、合约上的或其他方面的障碍。

8、本基金场外认购采用金额认购的方式，投资者通过代销网点首次认购本基金的单笔最低金额为人民币50,000元（含认购费），追加认购金额每笔不低于人民币50,000元（含认购费），投资者通过基金管理人直销中心首次认购本基金的单笔最低金额为人民币50,000元（含认购费）。追加认购金额每笔不低于人民币50,000元（含认购费），投资者通过基金管理人的电子交易系统首次认购本基金的单笔最低金额为人民币50,000元（含认购费），追加认购金额每笔不低于人民币50,000元（含认购费）。本基金募集期内对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。

本基金场内认购采用份额认购的方式，投资者通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000 份，超过50,000 份的须是1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不得超过99,999,000 份。本基金募集期内对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

9、《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在基金募集期间产生的利息将折合成基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册