诺德增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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

二〇一三年四月

重要提示

1、诺德增强收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会2008年12月14日证监许可【2008】1392号文核准。本基金的基金合同于2009年3月4日生效。

2、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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

3、基金管理人依照恪尽职守、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。

4、本基金主要投资于固定收益品种并参与新股申购(含增发)和套利性机会投资,其中对债券类(包括可转债)资产的投资比例不低于基金资产净值的80%,持有的非债类资产不高于基金资产净值的20%,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%。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,本基金的特定风险,等等。投资有风险,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。基金管理人提醒投资者"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。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、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

6、本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,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》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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。

7、本招募说明书所载内容截止至 2013 年 3月 4 日,财务数据和净值表现截止至 2012 年12月31日(财务数据未经审计)。

一、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:杨亿风
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:发起、设立和销售证券投资基金;管理证券投资基金;经中国证监会批准的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)。
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿元人民币
联系人:Alan Chang (张纶)
联系电话:021-68879999
股权结构:
Lord, Abbett & Co.LLC 49%
长江证券股份有限公司 30%
清华控股有限公司 21%

管理基金: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、诺德双翼分级债券型证券投资基金、诺德周期策略股票型证券投资基金、诺德深证300指数分级证券投资基金。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员:

杨亿风先生,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。

董腊发先生,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。董腊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:

秦蓬先生,监事。中国人民大学MBA,现任紫光股份有限公司副总裁兼财务总监,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、资产管理中心主任。

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方正数码公司总裁。

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,历任财务总部副总经理、经理。

竺筠女士,监事。南京财经大学学士,现任诺德基金管理有限公司综合管理部经理,曾任职于无锡市出入境检验检疫局。

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旗下诺德周期策略股票型基金基金经理、诺德主题灵活配置混合型基金基金经理,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:

杨亿风先生,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。

张欣先生,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

张鲜先生,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及诺德优选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,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,先后担任债券交易员,固定收益研究员等职务。现担任本基金基金经理及诺德双翼分级债券型证券投资基金基金经理。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。

二、基金托管人

一、基金托管人情况
(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2012 年9月30日,中国建设银行资产总额132,964.82亿元,较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月,中国建设银行实现净利润1,585.19亿元, 较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%, 年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元,较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%,净利息收益率为2.74%,分别较上年同期提高0.01和0.06 个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元,较上年同期增长1.64%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科、台北设有代表处,海外机构已覆盖到全球13 个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家,拥有建行亚洲、建银国际,建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年"全球银行1000强"中位列第6,较去年上升2位;在美国《财富》世界500强中排名77位,较去年上升31位;在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位,较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的"亚洲企业管治年度大奖"的上市公司,并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的"中国最佳银行"、"卓越管理及公司管治"与"2011年度最具社会责任金融机构"等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工209人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构:
1.直销机构
名称: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
法定代表人:杨亿风
客户服务电话:400-888-0009 021-68604888
传真:021-68882526
联系人:孟晓君
网址:www.nuodefund.com
2.代销机构:
(1)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客户服务统一咨询电话:95533
网址:www.ccb.com
(2)中国银行股份有限公司
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖 钢
客户服务统一咨询电话:95566
网址:http://www.boc.cn
(3)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(4)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:孙建一
联系人:周晓霞
联系电话:0755-22166212
客户服务电话:95511-3
开放式基金业务传真:0755-25879453
网址:www.bank.pingan.com
(5)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人: 孔丹
客服电话:95558
联系人:丰靖
电话:010-65557083
传真:010-65550827
网址:http://bank.ecitic.com
(6)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:4008-888-999或95579
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券长网网址:www.95579.com
(7)广发证券股份有限公司
法定代表人:林治海
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
公司网站:广发证券网 http://www.gf.com.cn
(8)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:吴志明
电话: 020-87322668
传真: 020-87325036
联系人:林洁茹
客户服务电话:020-961303
网址:www.gzs.com.cn
(9)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
客户服务热线: 4008888666
网址:www.gtja.com
(10)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:程高峰、万鸣
联系电话:025-83290979
传真:025-84579763
(11)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦17-21层
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:0512-33396288
网址: http://www.dwzq.com.cn
(12)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
邮政编码:350003
法定代表人:兰荣
注册资金:22亿元人民币
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
邮政编码:200135
客服电话:4008888123
联系人:谢高得
业务联系电话:021-38565785
兴业证券公司网站(www.xyzq.com.cn)
(13)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
客户服务热线:95565
网址:www.newone.com.cn
(14)中信证券(浙江)有限责任公司
公司注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
公司办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表:刘军
邮政编码:310052
联系人:丁思聪
联系电话:0571-87112510
公司网站:www.bigsun.com.cn
客户服务中心电话:0571-96598
(15)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:顾伟国
联系人:田薇
客服电话:4008-888-888
传真:010-66568536
网址:www.chinastock.com.cn
(16)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn
(17)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场群楼8楼
法定代表人:杨宇翔
全国免费业务咨询电话:4008816168
开放式基金业务传真:0755-82400862
联系电话:4008866338
网址:http://www.PINGAN.com
(18)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系电话:4008888108
传真:010-65182261
联系人:权唐
公司网址:www.csc108.com
中信建投证券客户咨询电话:4008888108
(19)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179 号
法定代表人:凤良志
开放式基金咨询电话:全国:95578
开放式基金业务传真:0551—2272100
联系人:陈琳琳、李飞
公司网址:www.gyzq.com.cn
(20)海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021—23219000
传真:021- 23219100
客服电话:400-8888-001(全国)、021-95553
公司网址:www.htsec.com
(21)中航证券有限责任公司
注册地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
注册资本:13.2588亿人民币
企业类型:有限责任公司
联系人:余雅娜
联系电话:0791-6768763
公司网址:http://www.avicsec.com/
客服电话:400-8866-567
(22)金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人:陆涛
联系人:蒋浩
联系电话:0755-83025022
金元证券客服电话:4008-888-228
金元证券网址: www.jyzq.cn
(23)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
(24)上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市西藏中路336号
办公地址: 上海市西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
电话: 021-53519888
传真: 021-62470244
联系人:张瑾
客服电话:4008918918、021-962518或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.962518.com
(25)天相投资顾问有限公司
注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编:100140
办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层 邮编:100140
法定代表人:林义相
客服电话: 010-66045678
传真: 010-66045500
天相投顾网-网址: www.txsec.com
天相基金网-网址:www.txjijin.com
联系人:潘鸿
联系电话:010-66045446
(26)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
代表人:刘弘
联系人:牟冲
基金业务对外联系人电话:010-5832 8112
基金业务对外联系人传真:010-5832 8748
客户服务热线:400-887-8827
公司网址:www.ubssecurities.com
(27)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人:傅毅辉
公司联系人:卢金文
电话:0592-5161642
客服电话:0592-5163588
公司网址:www.xmzq.cn
(28)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人:李工
公司联系人:甘霖
电话:0551-5161821
传真:0551-5161672
客服电话:96518(安徽)/4008096518(全国)
公司网址:www.hazq.com/
(29)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-84683893
传真:010-84865560
网站:中信金融网www.ecitic.com
(30)宏源证券股份有限公司
注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人: 冯戎
联系人: 李巍
业务联系电话:010-88085201
客户服务热线:400-800-0562
宏源证券网站:www.hysec.com
(31)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
邮政编码:350003
法定代表人:黄金琳
开放式基金业务联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
开放式基金业务传真:0591-87383610
公司网址:www.hfzq.com.cn
(32)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人姓名: 朱科敏
基金业务对外联系人姓名:李涛
联系电话:0519-88157761
联系传真:0519-88157761
公司网址 http://www.longone.com.cn
客服电话 400-888-8588
(33)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦
法定代表人:岳献春
注册资金:21.77亿人民币
办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层
邮政编码:100005
客服电话:4006198888
联系人: 赵明
业务联系电话:010-85127622
公司网站(www.mszq.com)
(34)华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
办公地址:京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴 建
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn
(35)光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市静安区新闸路1508号
办公地址: 上海市静安区新闸路1508号
法定代表人: 徐浩明
联系人: 刘晨、李芳芳
电话: 021-22169999
传真: 021-22169134
客户服务电话: 4008888788、10108998
公司网址: www.ebscn.com
邮编: 200040
(36)信达证券股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(37)中信万通证券有限责任公司
法定代表人:张智河
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
基金业务联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
(38)方正证券股份有限公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层
邮政编码:410015
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电 话: 0731-85832343
传 真: 0731-85832214
全国统一客服热线:95571
方正证券网站:www.foundersc.com
(39)第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
客户服务或投诉电话:4008881888
公司网址:http://www.firstcapital.com.cn
(40)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人:张雅锋
联系人: 牛孟宇
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
客服电话:95563
网址:http://www.ghzq.com.cn
(41)上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人: 张茹
电话: 021-58870011
传真: 68596916
公司网址:www.ehowbuy.com
客服电话:400-700-9665
(42)深圳众禄基金销售有限公司
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
注册资本:2000万元人民币
组织形式:有限责任公司
存续期间:持续经营
联系人:汤素娅
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
网址:http://www.zlfund.cn及http://www.jjmmw.com
(43)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦12 楼
法定代表人:陈柏青
联系人:周嫣旻
电话:0571-28829790、021-60897869
传真:0571-26698533
数米基金网站:www.fund123.cn
数米基金客户服务电话:4000-766-123
(44)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号2 幢220 室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际B 座16 层
法定代表人:张跃伟
联系人:沈雯斌
联系电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(45)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
法定代表人:李晓涛
网站:www.ijijin.cn
客服电话:95105885
(46)包商银行股份有限公司:
注册地址:内蒙古包头市钢铁大街 6 号
办公地址:内蒙古包头市钢铁大街 6 号
法定代表人:李镇西
联系电话:0472-5109729
传真:0472-5176541
联系人:刘芳
公司网址:www.bsb.com.cn
客服电话:内蒙古地区:0472-96016
北京地区:010-96016
宁波地区:0574-967210
深圳地区:0755-967210
成都地区:028-65558555
(47)东北证券股份有限公司
地址:长春市自由大路 1138 号
法人代表:矫正中
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
客服电话:4006-000686
公司网址:www.nesc.cn
(48)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系电话: 021-38602377
传真: 021-38509777
联系人:方成
客服电话: 400-821-5399
公司网址: http:www.noah-fund.com
(49)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
电话:023-63786141
传真:023-63786212
联系人:张煜
客服电话:4008096096
网址:www.swsc.com.cn
(50)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
法定代表人:闫振杰
客服电话:400-888-6661
公司网站:www.myfund.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)注册登记机构:
名称: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
法定代表人:杨亿风
客户服务电话:400-888-0009 021-68604888
传真:021-68882526
联系人:张欣
网址:www.nuodefund.com
(三)律师事务所与经办律师:
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
联系电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:廖海、田卫红
(四)会计师事务所:
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人: 郁豪伟
经办会计师: 汪棣 薛竟

四、基金的名称

基金的名称:诺德增强收益债券型证券投资基金
基金类型:契约型开放式

五、基金的投资

(一)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。

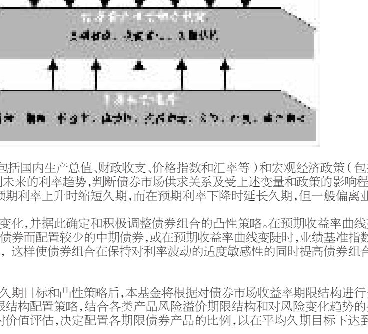
(二)投资理念
本基金管理人遵循严谨、科学的投资流程,通过专业分工细分研究领域,立足长期基本因素分析,从利率、信用等角度进行深入研究,形成投资策略,优化组合,获取可持续的、超出市场平均水平的稳定投资收益。在固定收益资产所提供的稳定收益基础上,根据股票市场一级市场股票及资金供求关系,适当参与新股发行申购及增发新股申购等风险较低的投资品种,为基金持有人增加收益,实现基金资产的长期稳定增值。

(三)投资范围
本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行及交易的国债、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。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
本基金可参与一级市场新股申购和增发新股等, 本基金可持有因可转债转股等所得到的股票及持股期间内所发生的送股、配股和权证等,以及由可分离交易可转债中分离交易的权证;本基金也可直接进行股票二级市场投资,但不主动进行二级市场的权证投资。
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%。

(四)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。

1、资产配置策略
本基金将采取较为稳健的资产配置策略,严格控制基金净值下行波动的风险。本基金投资组合将全面配置各种期限和信用等级的债券类产品;同时,适度参与回购市场的投资以及在预期收益高于预期风险的情况下参与一级市场新股申购和增发新股;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。

2、债券投资策略
根据本基金资产总体配置计划,债券资产投资组合的构建将通过"自上而下"的过程,即首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化;其次,在判断利率变动趋势时,全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。然后,在此基础上本基金将使用"自下而上"的投资策略,考虑债券的信用等级、期限、品种、流动性、交易市场等因素,依据收益率曲线、久期、凸性等指标和相对价值分析研究建立以严格控制久期、控制个券风险暴露度和控制信用风险暴露度为核心的由不同类型、不同期限债券品种构成的债券资产投资组合,并动态实施对投资组合的管理调整,以获取超出比较基准的长期稳定回报。



(1)确定组合久期和凸性策略
本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策和汇率政策等)进行分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场供求关系及受上述变量和政策的影响程度,并据此确定和积极调整债券组合的平均久期,在预期利率上升时缩短久期,而在预期利率下降时延长久期,但一般偏离业绩基准指数久期的范围不超过三年。
预测收益率曲线陡峭度的可能变化,并据此确定和积极调整债券组合的凸性策略。在预期收益率曲线变平时,相对于业绩基准指数配置较多的短期和长期债券而配置较少的中期债券,或在预期收益率曲线变陡时,业绩基准指数配置较多的中期债券而配置较少的短期和长期债券, 这样使债券组合在保持对利率波动的适度敏感性的同时提高债券组合的凸性而获得较高的总投资收益。

(2)确定组合期限结构
在确定本基金债券组合的平均久期目标和凸性策略后,本基金将根据对债券市场收益率期限结构进行分析,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,结合各类产品风险溢价期限结构和对风险变化趋势的判断,并考虑产品的流动性和其它结构特性,进行相对价值评估,决定配置各期限债券产品的比例,以在平均久期目标下达到预期投资收益最大化的目的

(3)确定个券形成组合
在确定本基金债券组合的期限结构后,本基金将研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,对不同类型债券产品进行相对价值分析,包括对票息及付息频率、信用风险、隐含期权、债券条款、税赋水平、市场流动性和市场风险等因素进行分析,判断个券的投资价值,选取风险收益相匹配的券种构建投资组合,以获取不同债券类属之间及不同个券间利差变化所带来的投资收益。在具体进行相对价值分析时,本基金将考虑多种策略,包括利差交易、凸性套利、息差策略、骑乘收益率曲线等。

(4)可转换债券的投资
可转换债券兼具股性和债性的双重特征,其内在价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值。同时,由于市场的流动性因素影响,可转换债券的市场交易价格相对于其内在价值会存在不同程度的溢价。本基金将通过对可转换债券内在价值的评估,选择投资价值相对低估的可转换债券。
本基金将借助基金管理人股票分析团队的研究成果, 对可转债的基础股票的基本面进行分析, 包括所处行业的竞争情况、公司的盈利模式和成长性等,并参考同类公司的估值水平,形成对基础股票的价值评估和股价波动性变化的趋势,从而判断可转换债券的股权投资价值;基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;根据可转债换股条款,采用期权定价模型,估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素,确定可转换债券的内在价值,并根据可转换债券的市场溢价进行相对价值分析,进行可转换债券的投资。

(5)资产支持证券投资
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及信用风险和提取偿还率等多种因素影响,其估值方法主要是以根据长期历史统计数据建立的数量化模型为基础。本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(6)债券组合风险管理
由于债券组合主要面临利率风险、信用风险、流动性风险和合同条款风险,本基金将主要通过以下四个方面来进行:1)管理久期,保持对利率的适度敏感度,并定期进行不同利率条件下组合估值敏感度分析,避免因对利率走势判断失误而造成较大损失;2)对债券发行主体进行独立的信用分析和跟踪,充分理解各项条款,进行最坏情形下的压力测试,防止或减少因信用风险而造成的损失;3)采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的风险水平与预期收益相匹配;4)进行流程化管理,由专人负责针对债券的合同条款的相应管理和提示执行工作,并设立多项交叉监控措施,确保遵守和使用债券的合同条款为投资产生较好收益或提供较好保护。此外,本基金将实行严格的投资权限管理,确保风险管理措施的有效性。

3、非债券产品投资策略
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。
新股投资策略:本基金将对股票的基本面进行分析,包括所处行业的竞争情况、公司的盈利模式和成长性等,并参考同类公司的估值水平,形成对股票的价值评估,从而判断一、二级市场价差的可能大小,并根据资金成本、新股的中签率及上市后股价涨幅的统计,制定新股申购策略。在新发股票获准上市后,本基金将根据对股票内在投资价值的判断,结合股票市场环境的分析,择机卖出。
二级市场投资策略:本基金在二级市场股票投资上采取"由上到下"的优势行业和"由下到上"的个股精选相结合的投资策略。根据国内市场的具体特点,本基金积极利用诺德安博特在全球市场的研究资源,并结合本地长期深入的公司调研和严格审慎的基本面与市场面分析,筛选出优势行业和其中的重点股票。
本基金不主动进行权证的投资。对分离交易的可转换公司债券,在认股权证上市后,本基金将根据权证估值模型的分析结果,在权证价值被高估时,选择适当的时机卖出。

(五)投资管理程序
1、债券研究员以及金融工程分析师负责研究分析工作,完成宏观研究报告、债券市场策略报告、市场统计报告等投资分析报告,并提出投资建议,为投资决策委员会和基金经理提供投资决策依据。
2、基金经理从本产品投资目标出发,依据内部投资分析报告、投资建议和外部研究成果,制定资产配置预案,并提交投资决策委员审议。
3、投资决策委员会作为基金管理公司投资活动的最高级别决策机构,以集体科学决策的方式,在严格遵守委托投资管理合同和控制投资的系统性风险的前提下,审议基金经理提交的资产配置预案,并最终确定资产配置方案。
4、基金经理依据经投资决策委员会批准的资产配置方案,制定具体投资计划,下达交易指令交由中央交易室执行。交易部依据基金经理的指令,制定交易计划,通过交易系统执行投资组合的买卖,并将交易结果及时向基金经理反馈。
5、风险管理小组根据市场变化对投资组合进行风险评估和监控,出具风险报告对资产配置和调整提出风险防范建议,对投资组合风险隐患提出预警。此外,风险管理小组还需要定期对本产品的投资业绩做出评价,出具业绩评估报告。
6、监察稽核部对整个投资流程进行合规检查和监督。

(六)业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为"中国债券总指数(全价)收益率*90%+沪深300指数收益率*10%"。
本基金定位于债券型基金,主要投资于债券类资产,债券类资产占基金资产净值的80%-95%。中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,能够反映债券市场总体走势,具有较强的代表性、权威性,并得到投资者的广泛认同,因此,本基金选取中国债券总指数(全价)收益率作为本基金债券组合的业绩比较基准;
本基金也可直接进行股票二级市场投资,持有的非债类资产为基金资产净值的0-20%。在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后,我们选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准;
本基金在正常的市场情况下,基金的平均债券仓位约为基金资产净值的90%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化,或者将来有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时, 基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略, 确定变更基金的业绩比较基准,并经基金管理人与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以变更本基金业绩比较基准,并及时公告。

(七)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。

(八)投资组合限制与禁止行为
1. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;
(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
2. 投资组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(6)本基金对债券类(包括可转债)资产的投资比例不低于基金资产的80%。本基金持有的非债类资产不高于基金资产的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%;
(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(13)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;
(14)如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。除投资资产配置比例外,基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

六、基金的投资组合报告

※本投资组合报告内容节选自《诺德增强收益债券型证券投资基金季度报告(2012第4季度)》,报告截至日期为2012年12月31日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	110,947,230.89	78.70
	其中:债券	110,947,230.89	78.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	15,000,001.00	10.64
	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	10,341,889.60	7.34
6	其他各项资产	4,690,540.26	3.33
7	合计	140,979,661.75	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	388,940.90	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	110,558,289.99	79.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	110,947,230.89	79.89

5 报告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

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(%)
1	041258035	12西塞山CP001	100,000	10,020,000.00	7.22
2	041269014	12大恒CP001	100,000	10,018,000.00	7.21
3	041259048	12东北合金CP002	100,000	10,012,000.00	7.21
4	112069	12明牌债	70,000	7,280,000.00	5.24
5	112088	12富春01	60,000	6,180,000.00	4.45

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 报告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 投资组合报告附注
8.1 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。
8.2 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。
8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	1,982,913.66
3	应收股利	-
4	应收利息	2,455,026.60
5	应收申购款	2,600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,690,540.26

8.4 报告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转股期可转债。
8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

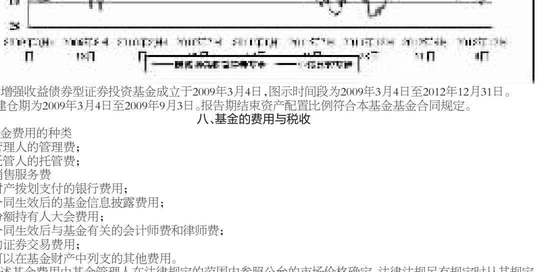
七、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。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。

本基金合同生效日为2009年3月4日,基金合同生效以来(截至2012年12月31日)的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如下表所示:

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
2009年3月4日至2009年12月31日	3.60%	0.29%	3.50%	0.21%	0.10%	0.08%
2010年1月1日至2010年12月31日	4.14%	0.35%	-1.83%	0.18%	5.97%	0.17%
2011年1月1日至2011年12月31日	-8.37%	0.34%	-0.45%	0.16%	-7.92%	0.18%
2012年1月1日至2012年12月31日	3.84%	0.14%	0.31%	0.14%	3.53%	0.00%
2009年3月4日至2012年12月31日	2.65%	0.29%	1.46%	0.17%	1.19%	0.12%

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2012年12月31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2012年12月31日。
本基金建仓期为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。

八、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金销售服务费
4.基金财产拨划支付的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
8.基金的证券交易费用;
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。
H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
3、基金销售服务费
基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
在通常情况下,本基金的销售服务年费率为0.4%,基金销售服务费计提的计
算公式如下:
H=E×0.4%÷当年天数
H 为每日应计提的基金销售服务费
E 为前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
4.除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
(四)不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
(六)基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

九、招募说明书更新部分说明

本基金于2009年3月4日成立,依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求, 结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动, 对2012年10月18日公告的《诺德增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)》进行内容补充和更新, 文字部分内容更新至2013年3月4日,数据部分内容更新至2012 年12月31日,主要更新内容说明如下:
(一)在"三、基金管理人"部分,对基金管理人概况和主要人员情况作了更新。
(二)在"五、相关服务机构"部分,更新了部分代销机构信息。
(三)在"十、基金的投资组合报告"中,根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。
(四)在"十一、基金的业绩"中,根据基金的实际运作情况,对本基金的业绩表现进行了说明。
(五)在"二十三、其他应披露事项"中,对披露的重要定期报告等重大公告事项予以了说明。
(六)在"重要提示"中新增了部分内容。
(七)对"四、基金托管人"做了修改。
(八)在"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分,对基金托管协议当事人信息做了部分修改。

诺德基金管理有限公司
二〇一三年四月十九日