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

二〇一四年十月

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导致的投资风险,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。

本招募说明书所载内容截止至 2014 年 9 月 4 日,财务数据和净值表现截止至 2014 年 6 月 30 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: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。

雷霖先生,董事。清华大学博士,现任清华控股有限公司副总裁、清控资产管理有限公司总裁,历任清华科技园技术资产经营有限公司副总经理、启迪控股股份有限公司财务总监、启迪控股股份有限公司副总裁、启迪创业投资管理有限公司董事总经理。

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。

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。

王岚女士,独立董事。北京大学法学学士,法国巴黎商学院(Paris School of Business)及美国华盛顿大学(University of Washington)访问学者。现任北京德恒律师事务所合伙人,曾任上海建纬律师事务所北京分所创始合伙人等职务。

2、基金管理人监事会成员:

李国文先生,监事会主席。中国人民大学法学学士,清华大学工商管理硕士,现任清华控股有限公司金融资产运营中心常务副总经理、清控资产管理有限公司副总裁,历任中国新兴建设开发总公司项目部主任、清华控股有限公司投资发展部高级经理、副部长、清控创业投资有限公司副总经理。

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,现任北京华创盛景投资管理有限公司合伙人、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,现任长江证券股份有限公司财务总部副总经理,历任财务总部副经理、经理。

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投资研究部基金经理,曾任清华兴业投资管理有限公司研究员。

刘静女士,监事。清华大学本科毕业,现任职于诺德基金管理有限公司综合管理部,曾任职于清华校友总会。

陈培阳先生,监事。清华大学法学学士,首尔大学国际通商硕士,现任诺德基金管理有限公司市场总监助理,曾任财富里昂证券有限责任公司法律合规专员,诺德基金管理有限公司监察稽核部经理。

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

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 2013 年 12 月 31 日,中国建设银行资产总额 153,632.10 亿元,较上年增长 9.95%;客户贷款和垫款总额 85,900.57 亿元,增长 14.35%;客户存款总额 122,230.37 亿元,增长 7.76%。营业收入 5,086.08 亿元,较上年增长 10.39%,其中,利息净收入增长 10.29%,净利息收益率(NIM)为 2.74%;手续费及佣金净收入 1,042.83 亿元,增长 11.52%,占营业收入比重为 20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为 29.65%。实现利润总额 2,798.06 亿元, 较上年增长 11.28%; 净利润 2,151.22 亿元, 增长 11.12%。资产质量保持稳定, 不良贷款率 0.99%, 拨备覆盖率 268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为 13.34%和 10.75%,保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构 14,650 个,服务于 306.54 万公司客户、2.91 亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013 年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外 102 项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志"全球银行 1000 强排名"中位列第 5,较上年上升 2 位;在美国《福布斯》杂志发布的"2013 年度全球上市公司 2000 强排名"中,位列第 2,较上年上升 13 位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

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、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工 220 余人。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。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 12 月 31 日,中国建设银行已托管 349 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至 2012 年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行";获和讯网的中国"最佳资产托管银行"奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的"最佳基金托管银行"奖;中央国债登记结算有限责任公司的"优秀托管机构"奖。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

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:杨忆风
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:周嬿旻
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
(51)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
联系电话:0.51-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618、95573
网址:www.i618.com.cn
(52)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人:王莉
客户服务电话:400-920-0022/ 021-20835588
网址:licaike.hexun.com
53)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201
法定代表人:李招弟
电话:010-59393923
传真:010 -59393074
联系人:高晓芳
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
(54)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人:其实
联系电话:021-54509998
传真:021-64385308
联系人:潘世友
公司网址:www.1234567.com.cn
客服电话:400-1818-188
(55)北京钱景财富投资管理有限公司
客服电话:400-678-5095
公司网站:www.niuji.net
(56)联讯证券股份有限公司
住所:惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人: 徐刚
传真: 021-33606760
客服电话: 95564
网址:http://www.lxzq.com.cn/
(57)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
客服电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com
(58)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
法定代表人:黄扬录
客户服务电话:4001-022-011
网址:www.zszq.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:杨忆风
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、刘佳

(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

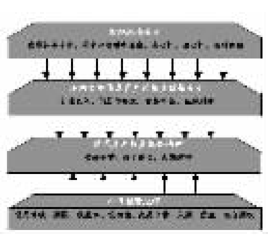
本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系,形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期,并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析,综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素,主动构建和调整投资组合,在获得稳定的息票收益的基础上,争取获得资本利得收益,同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性,从而达到控制投资风险,长期稳健地获得债券投资收益的目的。

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(2014 第 2 季度)》,报告截至日期为 2014 年 6 月 30 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	6,149,133.12	5.01
	其中:股票	6,149,133.12	5.01
2	固定收益投资	102,221,715.16	83.26
	其中:债券	102,221,715.16	83.26
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,422,896.95	6.05
7	其他各项资产	6,975,485.48	5.68
8	合计	122,769,230.71	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,257,000.00	1.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,892,133.12	4.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,149,133.12	5.31

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

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(%)
1	002033	丽江旅游	379,824	4,892,133.12	4.23
2	000592	平潭发展	150,000	1,257,000.00	1.09

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	190,057.00	0.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	74,556,706.24	64.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	27,474,951.92	23.73
8	其他	-	-
9	合计	102,221,715.16	88.28

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	126019	09长虹债	80,000	7,634,400.00	6.59
2	112015	09泛海债	75,000	7,517,100.00	6.49
3	112069	12明牌债	70,590	7,129,590.00	6.16
4	113002	工行转债	61,000	6,429,400.00	5.55
5	110015	石化转债	59,000	6,370,230.00	5.50

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序的前五名贵金属投资明细

本基金未投资贵金属。

8 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

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,290.76
2	应收证券清算款	5,177,859.78
3	应收股利	-
4	应收利息	1,757,335.41
5	应收申购款	23,999.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,975,485.48

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	6,429,400.00	5.55
2	110015	石化转债	6,370,230.00	5.50
3	113005	平安转债	6,302,380.00	5.44
4	110016	川投转债	4,315,524.60	3.73
5	110018	国电转债	2,087,200.00	1.80
6	125887	中鼎转债	1,356,888.40	1.17
7	128004	久立转债	613,328.92	0.53

11.5 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。

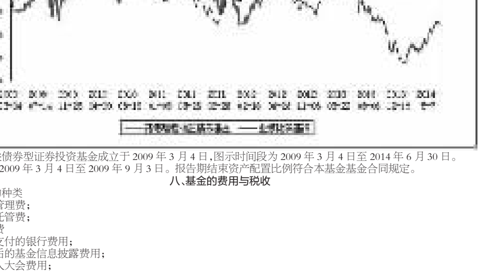
七、基金的业绩

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 2014 年 6 月 30 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%
2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	-0.20%	0.12%	-5.33%	0.18%	5.13%	-0.06%
2014年 1 月 1 日至 2914 年 6 月 30 日	3.71%	0.12%	3.12%	0.14%	0.59%	-0.02%

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 2014 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 2014 年 6 月 30 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》、《公开募集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 2014 年 4 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 2014 年 9 月 4 日,数据部分内容更新至 2014 年 6 月 30 日,主要更新内容说明如下:

(一)在"重要提示"部分修改了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。
(二)在"一、绪言"部分更新了本招募说明书的编写依据。
(三)在"二、释义"部分更新了对"运作办法"的定义。
(四)在"三、基金管理人"部分,对基金管理人主要人员情况进行了更新。
(五)在"四、基金托管人"部分,更新了信息。
(六)在"五、相关服务机构"部分,更新了部分代销机构及经办律师信息。
(七)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。
(八)在"十一、基金的业绩"中,根据基金的实际运作情况,对本基金的业绩进行了说明。
(九)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说明。

诺德基金管理有限公司
二〇一四年十月十四日