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

二〇一五年四月

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 2015 年 3月 4日，财务数据和净值表现截止至 2014 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：杨亿凤

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：

杨亿凤先生，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。

董慧发先生，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执行副总裁、长江期货有限公司董事长。董慧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。

梁麟能先生，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万正数码公司总裁。

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：

杨亿凤先生，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）。

2014年上半年，本集团实现利润总额1,695.16亿元，较上年同期增长9.23%；净利润1,309.70亿元，较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元，较上年同期增长14.20%；其中，利息净收入增长12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长8.39%。在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%，同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行公司机构客户326.89万户，较上年末增加20.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加921万户，增长3.17%；网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.56%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构总量14,707个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备72,128台，较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。

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240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

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，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。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，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2014年9月末，中国建设银行已托管389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年至今连续五年被国际权威杂志《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：杨亿凤

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.gzcs.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：程尚峰、刘鸣?

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：沈军

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：余熊娜

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：冯戎

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：邵忠民

电话： 021-53519888

传真： 021-62470244

联系人：张瑾

客服电话：4008918918、021-962518或按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）长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人：王勇

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：张鹏

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：吴志超

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1J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：汤素娟

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：周臻旻

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

（45）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及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）从事证担无限责任的投资；

（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%