

诺德优选 30 混合型证券投资基金

招募说明书（更新）

（2015 年 12 月）

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

【重要提示】

诺德优选 30 混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会 2011 年 3 月 4 日证监许可【2011】320 号文核准。本基金基金合同于 2011 年 5 月 5 日正式生效。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及各相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 8 日起“诺德优选 30 股票型证券投资基金”变更为“诺德优选 30 混合型证券投资基金”，并相应修订基金合同部分条款。因上述变更基金名称及基金类别事宜，基金管理人就《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了相应修改。此次变更基金名称并修订基金合同的事项对基金份额持有人的利益无重大实质影响，亦不涉及基金合同当事人的重大权利义务变化，依据法律法规和基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。详见诺德基金管理有限公司 2015 年 8 月 8 日披露的《关于诺德基金管理有限公司旗下股票型基金变更基金类别并修订基金合同的公告》。

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。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 11 月 4 日,有关财务数据截止日为 2015 年 9 月 30 日(未经审计)。

目 录

一、 绪 言	4
二、 释 义	4
三、 基金管理人	8
四、 基金托管人	17
五、 相关服务机构	19
六、 基金的募集及基金合同的生效.....	39
七、 基金份额的申购与赎回	39
八、 基金的转换	47
九、 基金的非交易过户与转托管.....	47
十、 基金份额的冻结、解冻及质押.....	48
十一、 定期定额投资计划	48
十二、 基金的投资	48
十三、 基金的业绩	58
十四、 基金的财产	60
十五、 基金资产的估值	62
十六、 基金的收益与分配	66
十七、 基金的费用和税收	67
十八、 基金的会计与审计	69
十九、 基金的信息披露	69
二十、 风险揭示	73
二十一、 基金合同的终止和基金财产的清算	76
二十二、 基金合同的内容摘要	77
二十三、 基金托管协议的内容摘要	91
二十四、 对基金份额持有人的服务	101
二十五、 其他应披露事项	103
二十六、 招募说明书的存放及查阅方式	104
二十七、 备查文件	104

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》)、《公开募集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《诺德优选 30 混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了诺德优选 30 混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资人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合同编写,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。基金投资人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。

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: | 指诺德优选 30 混合型证券投资基金; |
| 基金合同: | 指《诺德优选 30 混合型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《诺德优选 30 混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新; |
| 发售公告: | 指《诺德优选 30 股票型证券投资基金基金份额发售公 |

	告》
托管协议	指《诺德优选 30 混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
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》：	指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实 施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不 时做出的修订；
《运作办法》：	《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同 年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办 法》及颁布机关对其不时作出的修订；
《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代为办理本基金注册登记业务的机构；
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暂行办法》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购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；
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；
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。
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、应收申购款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；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
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基金份额净值的过程；
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。

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：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：张欣

联系电话：021-68879999

股权结构：

清华控股有限公司 51%

宜信惠民投资管理（北京）有限公司 49%

管理基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、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、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金，诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证 300 指数分级证券投资基金等。

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事会成员：

潘福祥先生，董事，总经理，代任董事长，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。

杨忆风先生，董事。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, Abnett & 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、董事长职务。

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。

唐宁先生，董事，美国 The University of the South 经济学学士。现任宜信惠

民投资管理（北京）有限公司执行董事、总经理，华创资本（CGC）董事长，宜信（香港）控股董事长，富安易达（北京）网络技术有限公司总经理，喆颢资产管理（上海）有限公司总经理。曾任美国 DLJ 投资银行部（DLJ Investment Bank）投资分析师，亚信（Asia Info）战略投资部总监。

侯琳女士，董事，北京大学法学学士、硕士。现任宜信惠民投资管理（北京）有限公司副总经理。

Qian Jun 先生，董事，浙江大学学士，美国 The University of Toledo 硕士，美国 Duke University 博士。宜信卓越财富投资管理（北京）有限公司总裁助理，曾任新华通讯社（北京）工程师，杭州高等专科院校教师，美国债券软件公司（Bond-Tech）金融软件工程师，美洲银行（美国）交易结构团队负责人，摩根士丹利（香港/中国）亚太地区的团队负责人，华宝信托总经理。

陈达飞先生，独立董事，对外经济贸易大学学士，University of Minnesota Law School 硕士。现任北京市汉坤律师事务所律师，曾任北京金杜律师事务所律师，高伟绅律师事务所律师，德普律师事务所律师。

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。

林嵩先生，独立董事，清华大学经济学学士、管理学硕士博士，纽约城市大学巴鲁克学院访问学者。现任中央财经大学商学院副书记、教授、博导。

2、基金管理人监事会成员：

刘大伟先生，监事，西安交通大学学士，国防科技大学硕士，清华大学硕士。现任宜信惠民投资管理（北京）有限公司总裁助理，曾任北京军区自动化站主任，北京市天元网络技术有限公司经理助理，宜信汇才商务顾问（北京）有限公司渠道总监。

薛雯女士，监事，苏州大学法学院法学学士、对外经济贸易大学法律硕士。现任清控资产管理有限公司内控业务总监，曾任启迪控股股份有限公司金融资产运营中心投资经理、建纬（北京）律师事务所律师、苏州正文人律师事务所律师。

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 FOHF 事业部副总监，投资经理，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、市场总监助理。

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。

3.公司高级管理人员：

潘福祥先生，董事，总经理，代任董事长。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

李圣春先生，第二军医大学医学硕士，2009年12月加入诺德基金管理有限公司研究部，先后担任了医药行业研究员、基金经理助理、基金经理等职务，曾先后任职于上海市中药研究所、上海药谷药业有限公司、上海用正医药科技有限公司、上海塔晶投资管理有限公司，具有基金从业资格，现任诺德优选 30 混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司总经理潘福祥先生、固定收益部总监赵滔滔先生。

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；
 - 11、采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
 - 12、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
 - 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
 - 14、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
 - 15、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
 - 16、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大

合同及其他相关资料；

17、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，根据招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

3、基金管理人不得从事违反《基金法》及其他法律法规的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）用基金财产承销证券；
- （6）用基金财产向他人贷款或提供担保；

-
- (7) 用基金财产从事无限责任的投资；
 - (8) 用基金财产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
 - (9) 以基金财产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
 - (10) 以基金财产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
 - (11) 用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - (12) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
 - (13) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议及有关法律法规；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，

扰乱市场秩序；

- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 参与洗钱或为洗钱活动提供协助；
- (15) 法律法规禁止的其他行为。

5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取利益。

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(4) 不得从事损害基金资产的行为。

(5) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，各个业务部门负责

本部门的内部控制，督察长和监察稽核部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

(2) 督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向中国证监会呈送督察长评估报告。

(3) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。监察稽核部对总经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，适时提出修改建议，并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

(4) 业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

5、基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

四、 基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2015年9月30日，中国银行已托管401只证券投资基金，其中境内基金375只，QDII基金26只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”

等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014 年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、 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：田国立

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：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：陈铭铭

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(4) 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：北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

(5) 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号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

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

(6) 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>

(7) 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

(8) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

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、39、41、42、43、44 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>

(9) 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

(10) 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

法定代表人：万建华

客户服务电话：400-888-8666

网址：www.gtja.com

(11) 华泰证券股份有限公司

住所：南京中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：南京中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：姜健

联系电话：025-83290979

网址：www.htsc.com.cn

(12) 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

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>

(13) 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

网址：www.xyzq.com.cn

(14) 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

(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

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

电话：010-66568430

联系人：田薇

公司网址：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

法定代表人：牛冠兴

联系电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：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：北京市朝阳区门内大街 188 号
法定代表人：张佑君
开放式基金咨询电话：4008888108
开放式基金业务传真：010-65182261
公司网址：www.csc108.com

(19) 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

(20) 中航证券有限公司
注册地址：南昌市抚河北路 291 号
法定代表人：杜航
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

(21) 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

(22) 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：021-962518或4008918918（全国）

业务联系电话：021-53519888

公司网址：www.962518.com

(23) 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

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：010-66045608

传真：(010) 66555500

客服电话：010-66045678

天相投顾：www.txsec.com

天相基金网：jijin.txsec.com

(24) 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

(25) 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

邮政编码：230069

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

(26) 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

(27) 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

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（28）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>

免费服务热线 400-888-8588

（29）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

网址：www.msza.com

（30）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

邮政编码：570206

法定代表人：陆涛

办公地址： 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

邮政编码： 518048

客服电话： 400-8888-228

联系人： 许方迪

业务联系电话： 0755-83025022

公司网站： www.jyzq.cn

(31) 国元证券股份有限公司

法定代表人： 凤良志

注册地址： 合肥市寿春路179号

办公地址： 合肥市寿春路179号

联系人： 陈琳琳、李飞

开放式基金咨询电话： 全国： 95578

开放式基金业务传真： 0551—2272100

公司网站： www.gyzq.com.cn(国元证券网)

(32) 方正证券股份有限公司

注册地址： 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

公司地址： 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

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

(33) 光大证券股份有限公司

注册地址： 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址： 上海市静安区新闻路 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

(34) 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

(35) 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

(36) 第一创业证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区福华一路投行大厦16-20层
办公地址：广东省深圳市福田区福华一路投行大厦16-20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>

（37）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

（38）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>

（39）深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

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：0755-33227951

网址：<http://www.zlfund.cn> 及 <http://www.jjmmw.com>

(40) 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

(41) 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：李晓明

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

(42) 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

(43) 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

(44) 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>

(45) 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

（46）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

（47）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

（48）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：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

网址: www.i618.com.cn

(49) 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

法人代表: 王莉

客户服务电话: 400-920-0022/ 021-20835588

网址: licaike.hexun.com

(50) 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

(51) 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

(52) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-678-5095

公司网站：www.niuji.net

(53) 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/>

(54) 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

(55) 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

(56) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：赵沛然

联系人电话：021-50583533

传真：021-50585353

网址：www.leadbank.com.cn

(57) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

联系人电话：028-86135991

传真：028-86150040

网址：<http://www.hx168.com.cn>

(58) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

(59) 上海汇付金融服务有限公司

客户服务电话：400-820-2819

网址：<https://tty.chinapnr.com/>

(60) 上海陆金所资产管理有限公司

客服电话：4008-219-031

网址：www.lufunds.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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 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 薛竞

六、 基金的募集及基金合同的生效

诺德优选 30 混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺德优选 30 股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】320 号），自 2011 年 4 月 1 日起向全社会公开募集，截至 2011 年 4 月 29 日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效认购户数为 7,984 户，本次募集扣除认购费用后的募集资金金额共计人民币 1,180,935,449.27 元，认购资金利息共计人民币 347,768.65 元，上述金额已于 2011 年 5 月 4 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的诺德优选 30 混合型证券投资基金托管专户。本次募集资金及其利息根据每份基金份额的面值人民币 1.00 元折合为 1,181,283,217.92 基金份额，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

经中国证监会核准，本基金的基金合同于 2011 年 5 月 5 日生效。本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限为不定期。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

七、 基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

条件成熟时，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

2、申购赎回的开始时间

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月时间内开始办理申购赎回，具体开始办理时间最迟于申购或赎回开始前 3 个工作日在本基金开放申购公告中规定并在至少一种指定媒体上公告。

3、基金管理人开始办理申购、赎回业务时应当按照基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

4、基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，认/申购确认日期在先的基金份额先赎回，认/申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

T日在规定时间之前提交的申购、赎回的申请，基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内支付。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

（五）申购和赎回的数额和价格

1、申购和赎回的数额限制

（1）对于本基金同一费用类别，投资人申购的单笔最低金额为 1000 元(含申购费)；基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金

额的限制。

(2) 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1000 份基金份额；每个交易账户的最低基金份额余额不得低于 1000 份，基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 1000 份的，需一次全部赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 1000 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

(3) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见定期更新的招募说明书。

基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须依照有关规定在至少一种指定媒体上公告。

2、申购赎回费率

(1) 申购费率：

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

申购费率如下：

申购金额（万元）	申购费率
A < 50	1.5%
50 ≤ A < 200	1%
200 ≤ A < 500	0.5%
A ≥ 500	每笔 1000 元

注：上表中，A 为投资者申购金额。

(2) 赎回费率

本基金的赎回费率如下表：

持有基金份额的期限	赎回费率
小于 1 年	0.5%
大于等于 1 年，小于 2 年	0.25%

大于等于 2 年	0
----------	---

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 赎回费总额 25% 的部分归基金财产所有, 其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更, 基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 在基金促销活动期间, 基金管理人履行适当程序后可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率。

3、申购份额的计算方法如下:

1) 当申购金额(含申购费)适用于比例费率时, 申购份额的计算方法如下:

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

例一, 假定某投资人申购本基金 10,000 元, T 日本基金的基金份额净值为 1.200 元。该笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下:

净申购金额 = $10,000 / [1 + 1.5\%] = 9,852.22$ 元

申购费用 = $10,000 - 9,852.22 = 147.78$ 元

申购份额 = $9,852.22 / 1.200 = 8,210.18$ 份

2) 当申购金额(含申购费)适用于固定金额费用时, 申购份额的计算方法如下:

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后两位, 由此误差产生的损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有。

4、赎回金额的计算

投资人赎回本基金的金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

赎回金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例二，假定某投资人在 T 日赎回其持有的基金份额 10,000 份，持有期不到 1 年，T 日的基金份额净值为 1.200 元，则投资人获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000×1.200=12,000 元

赎回费用=12,000×0.5%=60 元

赎回金额=12,000-60=11,940 元

5、基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。计算公式为：

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额的余额数量

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日登记在册的基金份额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留在小数点后三位，第四位四舍五入。由此产生的误差在基金财产列支。

（六）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人 T 日申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人 T 日赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上予以公告。

（七）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以上公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个或 2 个以上开放日以上发生连续巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

（八）拒绝或暂停接受申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 基金连续发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在至少一种指定媒体，刊登基金

重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

八、 基金的转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为。

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并按有关规定报中国证监会备案。

九、 基金的非交易过户与转托管

(一) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行，及经注册登记机构认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

1、“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

2、“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3、“强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

(二) 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(三) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构(网点)时，投资人可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十、 基金份额的冻结、解冻及质押

(一) 基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

(二) 如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十一、 定期定额投资计划

本基金管理人可为基金投资人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以基金管理人届时公布的业务规则和公告为准。

十二、 基金的投资

(一) 投资目标

本基金重点关注具备高成长潜力的行业和个股，在严格控制风险的前提下，通过集中投资于具备充分成长空间的和持续竞争优势的优质企业，谋求基金资产的长期稳定增值。

(二) 投资范围

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上市的 A 股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金秉持集中投资的理念，精选股票构建投资组合。具体投资范围及比例

分别为：股票投资占基金资产净值的比例范围为 60-95%，其中投资于基金持仓权重前 30 位股票的资产占股票资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的比例范围为 5-40%；其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（三）投资理念

本基金秉承长期投资和价值投资的理念，在过度分散和过度集中之间寻求一种平衡，精选股票构建投资组合，在对宏观经济、行业和企业基本面进行深入研究的基础上，挖掘成长性良好且经营稳健的企业，进行积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。

（四）投资策略

1、大类资产配置策略

在大类资产配置方面，本基金将从资产价格及股市特征、流动性和资金面、市场估值水平、上市公司业绩等方面入手，分析这些因素的现状和未来发展趋势。并综合以上四大因素确定组合中股票和债券等大类资产的配置比例。各个因素细分如下：

（1）经济周期中资产价格及股市特征

在考虑经济周期中的资产价格及股市特征时，本基金将着重考虑以下几个周期：反映市场供需关系变化的存货周期，反映投资变化的资本支出周期，反映宏观经济状况的房地产周期。根据对不同时期资产价格和股市特征的研究，判断所属的经济周期，确定相应的资产配置策略，并根据经济周期变化及时进行调整。

（2）流动性和资金面分析（结合全球流动性）

在进行流动性和资金面的分析时，本基金将着重考虑以下几个指标：反映信贷情况的信贷增速、M2 增速预测，反映货币供给的热钱规模、M1 增速走势、

反映货币需求的未来 1 年融资规模，反映短期流动性的机构仓位、开户数等。

（3）当前估值水平测算及未来变化趋势

在对估值进行评估时，本基金将运用多种方法来估计大盘的合理点位：运用股利贴现模型（Dividend Discount Model，简称 DDM）模型计算 A 股绝对估值；使用计量回归模型测算 A 股估值；通过历史数据比较 A 股历史相对估值。在估计未来变化趋势时，通过比较各大类资产的收益率，对估值水平未来的变化趋势作综合判断。

2、行业资产配置策略

本基金将从“成长特性”和“安全边际”两个角度对行业进行全面评估。同时具备充分成长空间和合理安全边界的行业，是本基金重点关注的行业。

（1）自上而下寻找高成长性行业

本基金重点关注有中长期增长潜力的行业，非常重视经济周期波动过程中行业景气轮动带来的成长型投资机会。本基金认为，考虑到中长期内经济转型的必然性，基于经济转型的成长性投资策略，在中长期内将非常有效。在转型背景下的行业选择，可以从七大战略新兴产业和传统产业的升级改造两个层面着手。

战略新兴产业是指国务院下发的《关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》中明确的将从财税金融等方面出台一揽子政策加快培育和发展的战略性新兴产业，《决定》指出根据战略性新兴产业的特征，立足我国国情和科技、产业基础，现阶段重点培育和发展节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等产业。七大战略新兴产业指的就是上述《决定》中明确列举的七大产业。相对战略新兴产业而言，传统产业主要指劳动力密集型的、以制造加工为主的行业。

新兴产业由于具有技术优势、政策优势等，虽然当前产业市值占国内生产总值（GDP）的比重不大，但是未来增长潜力较大，本基金选择上述七大战略新兴产业进行重点研究和挖掘是看中其未来投资机会和潜在回报空间。传统产业虽然不具备新兴产业的诸多政策技术优势，但是我国目前仍然是一个传统产业占主体地位的国家，传统产业占国内生产总值（GDP）的比重非常大，传统产业受到新兴产业发展的挤压，面临满足人民日益增长的物质文化需要的迫切要求，传统产

业从自身出路的角度未来升级改造、进行转型的可能性和必要性非常高，能够成功升级改造转型的传统产业同样具有较大的投资吸引力，因此本基金也将重点研究和挖掘众多传统产业升级改造和转型过程中蕴含的投资机会。

上述七大战略新兴产业是现阶段我们对新兴产业定义并列举的产业，如果今后国家对战略新兴产业的定义和范围进行修改，本基金也将根据国家最新的政策、定义和范围调整本基金具体的行业资产配置策略。

（2）必要的安全边际

本基金重点关注成长型行业，并以合理的价格进行投资。本基金将通过市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈率相对盈利增长的比率（PEG）等指标严格控制所选行业的估值水平。

3、股票投资策略

在“自上而下”的研究圈定成长型行业的基础上，本基金将通过全面深入的个股研究和密切跟踪调查，寻找成长行业内具备高成长预期和行业竞争优势的公司，同时通过优选 30 只左右的股票构建投资组合、对所选的行业和公司进行密切跟踪的方法来控制个股风险。

在个股研究方面，本基金重视“自下而上”研究方法，通过建立一套良好的定量和定性的筛选体系，力图选出具备长期成长潜力的公司。本基金将重点考察这些公司是否具有坚实的商业基础、出色的管理水平、独特的盈利模式、良好的成长潜力，同时估值是否相对合理等。本基金将依据一定的管理流程筛选三级股票池：初选股票池、优选股票池、核心股票池。第一步：本基金根据每股收益（EPS）、剔除非经常损益后的净利润增长率在行业内的排名等定量指标筛选得到初选股票池；第二步：在初选股票池的基础上，研究员根据实地调研或基于市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈率相对盈利增长的比率（PEG）、行业特有指标等定量指标的初步估值分析对初选股票池名单进行增补，最终得到优选股票池；第三步：在优选股票池的基础上，研究员通过对上市公司进行持续跟踪、多次实地调研、对公司三大财务报表构建三种不同情景假设（保守、客观及乐观）下的深度估值分析等方法确定各自负责行业内重点推荐的个股名单，汇总后构成核心股票池。以上三级股票池的构建过程中风险控制部门都会根据法律法规、基金合同和公司内部的风险控制制度进行合规合法审核。

4、债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，综合判断后对利率走势形成合理预期，并通过久期管理和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析权证合理定价的基础上进行积极操作，追求在风险可控的前提下的稳健收益。

6、资产支持证券投资策略

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。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数} \times 80\% + \text{同业存款利率} \times 20\%$

沪深 300 指数具有覆盖面广、编制合理、透明度高、运用广泛、市场代表性强等特点，而本基金股票资产的配置比例为 60-95%，中位值约为 80%，故本基金采用沪深 300 指数和同业存款利率加权组成的复合型指数作为本基金业绩比较基准，能够真实反映本基金的风险收益特征，同时也能较恰当衡量本基金的投资业绩。

基于本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

（七）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （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）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- （1）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）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- （3）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%；
- （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）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）本基金股票资产投资比例占基金资产净值的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；
- （8）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；
- （9）持仓权重前 30 只个股的总权重至少占股票资产的 80%；
- （10）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净

值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（八）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

（九）基金管理人代表基金行使股东及债权人权利处理原则和方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金投资人利益。

（十）基金的投资组合报告

※本投资组合报告内容节选自《诺德优选 30 混合型证券投资基金季度报告（2015 第三季度）》，报告截至日期为 2015 年 9 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	76,625,680.00	81.58
	其中：股票	76,625,680.00	81.58
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,225,321.76	10.89
7	其他各项资产	7,081,230.09	7.54
8	合计	93,932,231.85	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	3,782,500.00	4.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,379,480.00	36.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,426,100.00	16.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,728,300.00	12.61
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	1,619,000.00	1.74
L	租赁和商务服务业	4,020,000.00	4.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,670,300.00	6.09
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	76,625,680.00	82.35

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	600594	益佰制药	330,000	5,237,100.00	5.63
2	002630	华西能源	460,000	4,324,000.00	4.65
3	600483	福能股份	300,000	4,122,000.00	4.43
4	600138	中青旅	200,000	4,020,000.00	4.32
5	002104	恒宝股份	250,000	3,902,500.00	4.19
6	002714	牧原股份	85,000	3,782,500.00	4.07
7	600697	欧亚集团	160,000	3,704,000.00	3.98
8	002573	国电清新	210,000	3,702,300.00	3.98
9	600979	广安爱众	600,000	3,678,000.00	3.95
10	600511	国药股份	120,000	3,519,600.00	3.78

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

5 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债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

6 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资产支持证券投资 投资明细

本基金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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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	103,448.93
2	应收证券清算款	6,946,241.98
3	应收股利	-
4	应收利息	1,934.27
5	应收申购款	29,604.91

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,081,230.09

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有处于转股的可换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十三、 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。

1 本报告期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	净值增长率①	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
2015年1月1日-2015年9月30日	26.65%	3.38%	-6.45%	2.16%	33.10%	1.22%

2014年1月1日至2014年12月31日	12.81%	1.27%	40.15%	0.97%	-27.34%	0.30%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.86%	1.40%	-5.68%	1.12%	20.54%	0.28%
2012年1月1日至2012年12月31日	-7.97%	1.30%	6.49%	1.02%	-14.46%	0.28%
2011年5月5日至2011年12月31日	-21.00%	1.05%	-20.33%	1.04%	-0.67%	0.01%

2 自基金合同生效以来基金累计份额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

诺德优选 30 混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年5月5日至2015年9月30日)



注：诺德优选 30 混合型证券投资基金成立于 2011 年 5 月 5 日，图示时间段为 2011 年 5 月 5 日至 2015 年 9 月 30 日。本基金建仓期为 2011 年 5 月 5 日至 2011 年 11 月 4 日。报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十四、 基金的财产

（一）基金财产的构成

1、基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- （1）银行存款及其应计利息；
- （2）清算备付金及其应计利息；
- （3）根据有关规定缴存的保证金；
- （4）应收证券交易清算款；
- （5）应收申购基金款；
- （6）股票投资及其估值调整；

-
- (7) 债券投资及其估值调整和应计利息；
 - (8) 权证投资及其估值调整；
 - (9) 其他投资及其估值调整；
 - (10) 其他资产等。

2、基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二) 基金财产的账户

本基金以“诺德优选 30 混合型证券投资基金”的名义在基金托管人营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以“诺德优选 30 混合型证券投资基金”的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和“诺德优选 30 混合型证券投资基金”联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户、以“诺德优选 30 混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

(三) 基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十五、 基金资产的估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

（3）有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上

市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，

按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、如本基金投资金融衍生产品，将按法律法规及中国证监会的有关规定予以估值。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-6 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果报送给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变时，基金管理人为保障

投资者的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情况的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 7 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十六、 基金的收益与分配

（一）收益的构成

基金利润是指基金的利息收入、投资收益、公允价值的变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益是指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

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。

（三）基金收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 20 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不超过 15 个工作日；

7、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；

8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日经除权后的基金份额净值转为基金份额。收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

十七、 基金的费用和税收

（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、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7、基金资产的资金汇划费用；
- 8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召

开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十八、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日，如果基金成立少于2个月，可以并入下一个会计年度。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

十九、基金的信息披露

（一）披露原则

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息

通过中国证监会指定的报刊和网站披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（二）基金募集信息披露

1、基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

2、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

4、基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（三）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年

度报告和基金季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（四）基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定媒体上公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场最后一个交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（五）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；

-
- 3、转换基金运作方式；
 - 4、更换基金管理人、基金托管人；
 - 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
 - 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
 - 7、基金募集期延长；
 - 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
 - 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
 - 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
 - 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
 - 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
 - 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
 - 14、重大关联交易事项；
 - 15、基金收益分配事项；
 - 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
 - 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
 - 18、基金改聘会计师事务所；
 - 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
 - 20、基金更换基金注册登记机构；
 - 21、基金开始办理申购、赎回；
 - 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
 - 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
 - 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
 - 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
 - 26、基金份额上市交易；
 - 27、基金份额持有人大会的决议；
 - 28、中国证监会规定的其他事项。

（六）澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（七）中国证监会规定的其他信息

（八）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

二十、 风险揭示

（一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1、政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、

技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5、通货膨胀风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

6、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

（二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

（三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

（四）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资人的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管

理人并不保证完全避免此类风险。

（五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

（六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

（七）本基金特有的风险

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。首先，本基金主要投资于有巨大价值上涨潜力的上市公司股票，高收益的同时也有相对高的风险。其次，本基金对股票的选择在很大程度上是依据上市公司财务数据和其他基本面数据，而这些数据可能会失真，同时预测价值上涨潜力受主观因素影响较大，可能产生误差。这些因素都将使本基金收益水平呈现一定程度的不确定性，从而给投资人带来风险。再次，由于本基金采用相对集中投资的策略，如果发生预判错误，则风险也会集中，从而会造成基金业绩波动。

（八）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

二十一、 基金合同的终止和基金财产的清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金的基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、因重大违法、违规行为而被中国证监会责令终止的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后才能收回。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二、 基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人的权利与义务

基金管理人的权利

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

(3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、

申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6) 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

基金管理人的义务

-
- (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；
 - (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
 - (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
 - (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
 - (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
 - (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
 - (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
 - (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会

或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

2、基金托管人的权利与义务

基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割

事宜；

(9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 复核审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(14) 按规定审查制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

(18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

(19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

(2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

(5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(4) 更换基金管理人、基金托管人；

(5) 变更基金类别；

(6) 变更基金投资目标、范围或策略；

(7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

(8) 本基金与其他基金合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响等其他事项；

(10) 法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费率、基金托管费率；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 代表基金份额 10%的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人

持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第(二)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(2) 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

9、计票

(1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果

后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监票人在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人经通知后无故不派代表监督计票的，不影响计票效力。

10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2个工作日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

(4) 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形,或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的,可不经基金份额持有人大会决议,而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布,并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的,基金合同应当终止:

- (1) 基金份额持有人大会决定终止;
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;
- (3) 因重大违法、违规行为而被中国证监会责令终止的;
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定,行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止,基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

(2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组,在基金财产清算组接管基金财产之前,基金管理人和基金托管人应依照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

(3) 清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生后,由基金财产清算组统一接管基金财产;
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;

4) 对基金财产进行评估和变现;

5) 制作清算报告;

6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

8) 对基金财产进行分配。

(4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

1) 支付清算费用;

2) 交纳所欠税款;

3) 清偿基金债务;

4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)、2)、3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

(6) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议的处理

1、基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可通过友好协商解决, 但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的, 则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外, 基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续

履行。

(五) 基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十三、 基金托管协议的内容摘要

(一) 基金托管协议当事人

1、 基金管理人

名称： 诺德基金管理有限公司
住所： 上海陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 层
法定代表人： 杨忆风
成立时间： 2006 年 6 月 8 日
批准设立机关： 中国证监会
批准设立文号： 中国证监会证监基字[2006]88 号
组织形式： 有限责任公司
注册资本： 壹亿元人民币
存续期间： 持续经营
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）。

2、 基金托管人

名称： 中国银行股份有限公司
住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人： 田国立
成立时间： 1983 年 10 月 31 日
基金托管业务批准文号： 中国证监会证监基字【1998】24 号
组织形式： 股份有限公司
注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理

票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

（2）对基金投融资比例进行监督，基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 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) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 3) 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%；
- 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) 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) 本基金股票资产投资比例占基金资产净值的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其

他金融工具占基金资产净值的 5%-40%；

7) 本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；

8) 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；

9) 持仓权重前 30 只个股的总权重至少占股票资产的 80%；

10) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

(3) 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施；

(4) 基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督。

(5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

- 1) 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；
- 2) 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；
- 3) 如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报基金管理人的投资总监批准。

(6) 基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

(7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人在上述第 1、2 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

5、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(三) 基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在《托管协议》的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

（1）基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、

基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

（2）基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、基金的银行账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

（3）本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

（1）基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结

算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

6、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

(五) 基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应在相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信

息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并发送给基金托管人。基金托管人应在收到净值后对净值计算结果进行复核，并将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(3) 当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金资产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

(5) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

(6) 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人及基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措

施消除由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

2、基金会计核算

(1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

(2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人

应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

（七）适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

（八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十四、 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）对账单服务

基金投资人对账单包括电子对账单、短信对账单、纸质对账单，服务形式为账单定制服务。投资人可以根据个人需求，选择获得账单的形式。本公司将根据

投资者定制的对账单服务方式提供对账单。

投资人可通过以下途径，选择对账单服务形式：

1、通过拨打本公司热线电话 4008880009-0 转人工坐席，告知客服专员选择的对账单服务方式。

2、通过本公司网站（www.nuodefund.com）“客户服务”页面，输入开户证件或基金账号登录基金账户（初始密码开户证件后六位）进入“服务定制”栏目进行定制。

3、投资人也可直接发送电子邮件到本公司客服邮箱（service@nuodefund.com），在邮件中注明开户证件号码、姓名、持有基金名称、手机号码或 E-mail 地址，定制短信对账单或邮件对账单（二者可一并定制）。

（二）基金间转换服务

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。

（三）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。该定期定额投资计划的有关规则另行公告。

（四）网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：<http://www.nuodefund.com>

（五）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金投资人提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益

查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

（六）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

投资人拨打客户服务电话可通过自动语音或人工座席获得基金信息查询、账户信息查询、传真对账单、建议投诉等全面的服务。

客户服务电话：400-888-0009，021-68604888

客户服务传真：021-68882526

（七）投诉受理

投资人可以通过呼叫中心或公司网站，以电子邮件、信件、传真来访等形式，进行投诉，所有渠道的投诉设有专人登记，专人处理；普通投诉一个工作日内答复，重大投诉五个工作日内答复。若规定时间内无法处理完毕的，应及时答复进展状况。

（八）网上开户与交易服务

在技术条件成熟时，诺德基金及其合作机构将为投资人提供方便快捷的网上在线开户交易服务。

二十五、 其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德基金关于新增华西证券股份有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-27
2	诺德优选30股票型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-18
3	诺德优选30股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-18
4	诺德优选30股票型证券投资基金2015年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-07-18
5	关于诺德基金管理有限公司旗下股票型基金变更基金类别并修订	中国证券报、上海证券报、证券	2015-08-08

	基金合同的公告	时报、公司网站	
6	诺德基金关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-08-08
7	诺德优选30混合型证券投资基金2015年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-08-25
8	诺德优选30混合型证券投资基金2015年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-08-25
9	诺德基金关于新增申万宏源证券有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-09-12
10	诺德基金关于新增上海汇付金融服务有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-09-29
11	诺德基金管理有限公司关于旗下基金参加好买基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-10-16
12	诺德优选30混合型证券投资基金2015年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-10-27
13	诺德基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-10-28

二十六、 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

二十七、 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营

业场所，在办公时间内可供免费查阅。

（一）中国证监会核准诺德优选 30 股票型证券投资基金募集的文件（证监许可【2011】320 号）；

（二）《诺德优选 30 混合型证券投资基金基金合同》；

（三）《诺德优选 30 混合型证券投资基金托管协议》；

（四）《诺德优选 30 股票型证券投资基金代销协议》；

（五）《诺德优选 30 股票型证券投资基金份额发售公告》；

（六）法律意见书；

（七）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

（八）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（九）《诺德基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

（十）中国证监会要求的其他文件。

诺德基金管理有限公司
二〇一五年十二月十五日