

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型
基金中基金（FOF）

招募说明书（更新）摘要
（2020年1月）

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

二〇二〇年一月

【重要提示】

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会2019年8月9日证监许可【2019】1478号文注册。本基金于2019年12月9日生效。

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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金中基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式,但并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

本基金主要投资于证券市场中的其他公开募集证券投资基金的基金份额,为基金中基金,基金净值会因为证券市场波动、所投资的基金的基金份额净值波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,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,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/基金份额净值产生影响而形成的系统性风险,个别证券/持有基金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、合规性风险,本基金的特定风险等详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为混合型基金中基金,风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金,低于股票型基金、股票型基金中基金。

投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等

判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。投资人应当通过本基金管理人或销售机构购买本基金，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

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预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书的本次更新为依据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》所作出的相应修订，其余所载内容截至 2020 年 1 月 8 日。截至本招募说明书公告日，本基金无已披露的投资组合报告和净值表现数据。

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：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层

邮政编码：200120

法定代表人：潘福祥

成立日期：2006 年 6 月 8 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2006]88 号

经营范围：基金管理业务；募集、发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务。

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

联系人：孟晓君

联系电话：021-68985199

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%
------------------	-----

（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、总经理。

罗凯先生，董事、总经理，清华大学工商管理硕士。曾任职于江苏省交通产业集团投资发展处。2007年7月加入诺德基金管理有限公司，先后担任华北区渠道经理、华北区总监、市场总监助理、市场副总监兼专户理财部负责人、市场总监、副总经理。

薛嘉麟先生，董事，华中理工大学工学学士，北京邮电大学工学硕士。现任清控资产管理有限公司总裁，曾任朗讯科技（中国）有限公司贝尔实验室高级研究员，中关村科技软件有限公司咨询服务总监、副总裁、总裁，北京通软联合信息技术有限公司首席执行官，中国通关网首席运营官，启迪融资租赁有限公司总经理，启迪金控投资有限公司副总裁，清控资产管理有限公司投资业务总监、副总裁。

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。

尚筱女士，董事，河海大学经济学学士、清华大学工商管理硕士。现任宜信卓越财富投资管理（北京）有限公司高级副总裁，曾任上海博而思企业咨询服务股份有限公司咨询顾问、上海安硕信息科技有限公司高级经理。

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律师，曾任上海建纬律师事务所北京分所创始合伙人等职务。

许亮先生，独立董事，清华大学文学和经济学双学士，哈佛商学院 MBA。现任合一资本创始合伙人、董事长，新财知社董事长，曾任北京清华永新信息工程有限公司市场部副总裁，英特尔(中国)有限公司高级财务分析师、战略项

目经理，鼎晖投资基金管理公司助理副总裁，北京永新视博数字电视技术有限公司执行副总裁、首席财务官，博纳影业集团有限公司首席财务官、集团副总裁、光影工场文化传播有限公司董事长。

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风控总监，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。

冯奕先生，监事，北京广播学院（现更名为：中国传媒大学）学士，清华大学经管学院硕士。现任诺德基金管理有限公司北京分公司总经理，曾任清华兴业投资管理有限公司培训部经理、赛尔教育科技有限公司培训部总监、诺德基金管理有限公司公共事务总监。

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北京分公司，曾任职于清华校友总会、诺德基金管理有限公司综合管理部。

3、公司高级管理人员：

潘福祥先生，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、总经理。

罗凯先生，董事、总经理，清华大学工商管理硕士。曾任职于江苏省交通产业集团投资发展处。2007年7月加入诺德基金管理有限公司，先后担任华北区渠道经理、华北区总监、市场总监助理、市场副总监兼专户理财部负责人、市场总监、副总经理。

陈培阳先生，督察长，清华大学法学学士，国立首尔大学国际通商硕士。历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主管、监察稽核部负责人、市场总监助理、FOHF 事业部副总监，利得资本

管理有限公司法律事务副总监，华泰资产管理有限公司风险合规部总经理助理等职务。

严亚锋先生，首席信息官，南京大学学士。曾任杭州金宏智软件有限公司软件工程师、杭州新利软件有限公司开发部项目经理、上海华腾系统软件有限公司项目经理、华安基金管理有限公司信息技术部项目经理、天相投资顾问有限公司信息技术部总经理助理。2011年7月加入诺德基金管理有限公司，先后担任信息技术项目经理、信息技术部副经理、信息技术部总监。

4、本基金基金经理

郑源先生，香港理工大学计算机博士。曾任高扬集团有限公司（香港）投资经理、中国创新投资股份有限公司（香港）投资经理、华泰联合证券有限责任公司资深研究员、民生证券股份有限公司资深研究员以及中国银河证券股份有限公司高级研究员。2017年1月加入诺德基金管理有限公司，曾任投资经理职务，现任FOF管理部投资总监、深圳分公司总经理。

5、FOF基金投资决策委员会成员

公司总经理兼FOF管理部总监罗凯先生、FOF管理部投资总监兼深圳分公司总经理郑源先生、运营总监兼产品中心总监曹纲先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

成立时间：1993年8月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：66.99亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2014]78号

联系人：韩鑫普

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 249 家批准设立的证券营业部和 12 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东股权交易中心股份有限公司及证通股份有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

（二）主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。（三）基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2019 年四季度，招商证券共托管 36 只公募基金。（四）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

(1) 托管业务的经营运作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) 建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

(3) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

(4) 不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司的风险管理职能部门。

托管部内部设置专门负责稽核工作的内控稽核岗，配备专职稽核人员，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

(五) 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

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投

资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于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：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层

法定代表人：潘福祥

客户服务电话：400-888-0009 021-68604888

传真：021-68985121

联系人：许晶晶

网址：www.nuodefund.com

2、代销机构

（1）招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

客服电话：95565

网址: www.newone.com.cn

(2) 平安银行股份有限公司

住所: 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: 谢永林

客服电话: 95511-3

网址: www.bank.pingan.com

(3) 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

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: 曹实凡

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>

(4) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 赵俊

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

联系人: 王一彦

客服电话: 95531/400-8888-588

网址: www.longone.com.cn

(5) 鼎信汇金(北京)投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 1701 室

办公地址：北京市海淀区清华科技园科技大厦 C 座 17 层 1701 室

法定代表人：齐凌峰

客服电话：400-158-5050

公司网站：www.9ifund.com

(6) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

(7) 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 2-6 层

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：陈共炎

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

(8) 国都证券股份有限公司

注册住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

(9) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

客服电话：400-712-1212

公司网站：<http://www.dtsbc.com.cn>

(10) 中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

客服电话：(024) 95346

网址：www.iztzq.com

(11) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

法定代表人：吕春卫

客服电话：400-620-6868

网址：www.lczq.com

(12) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

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

法定代表人：冯鹤年

联系人：赵明

业务联系电话：010-85127622

客服电话：4006198888

公司网站：www.msyzq.com

(13) 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
客户服务电话：028-86135991
传真：028-86150040
网址：<http://www.hx168.com.cn>

(14) 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：吴坚
电话：023-63786141
传真：023-63786212
联系人：张煜
客服电话：4008096096
网址：www.swsc.com.cn

(15) 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：王连志
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

(16) 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：北京市朝阳区内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网址：www.csc108.com

(17) 珠海盈米基金销售有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

(18) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

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

(19) 万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：罗钦城

客服电话：95322

网址：www.wlzq.cn

(20) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

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>

(21) 财达证券股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 26 层

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 26 层

法定代表人：翟建强

客服电话：4006128888

公司网站：www.s10000.com

(22) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

(23) 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

(24) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

客服电话：95595

公司网站：www.cebbank.com

(25) 太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座

法定代表人：李长伟

客服电话：95397

公司网站：www.tpyzq.com

(26) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108_号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

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，并在基金管理人网站公示。

(二) 登记机构：

名称：诺德基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层

法定代表人：潘福祥

电话：400-888-0009

传真：021-68985090

联系人：武英娜

（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（特殊普通合伙）

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

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：潘晓怡

经办注册会计师：单峰、潘晓怡

四、基金的名称

本基金名称：诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

五、基金的类型

基金类型：混合型基金中基金

六、基金的运作方式

基金的运作方式：契约型定期开放式。

本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）至基金合同生效日所对应的3个月月度对日的前一日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至首个开放期结束之日次日所对应的3个月月度对日的前一日的期间，以此类推。如月度对日为非工作日，则顺延至下一个工作日，若该日历月度中不存在对应日期的，则下一个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。

本基金自每个封闭期结束后第一个工作日（含该日）起进入开放期，每个开放期不少于5个工作日，并且最长不超过15个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期内未赎回的基金份额将自动转入下一个封闭期。

如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

七、基金的投资目标

本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，通过积极主动的量化投资策略，进行全市场的资产配置和组合管理，追求基金资产的长期增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（但不包括 QDII 基金、香港互认基金）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不得投资分级基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中股票型基金、混合型基金的投资比例合计占本基金资产的 60%-90%；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内，本基金持有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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

九、基金的投资策略

本基金将结合宏观配置策略的灵活性、主观观点的可融入性和量化投资策略纪律严格、风险水平可控的优势确定基金大类资产配置比例，并根据市场环境变化进行动态管理，再通过定量和定性相结合的方式优选标的基金构建投资组合，力争在严格控制整体风险的前提下，实现基金的长期稳定增值。

1、大类资产配置策略

本基金的大类资产主要分为，权益类资产(包括股票型基金、混合型基金)；固收类资产(主要包括债券、债券型基金等)，以及流动性资产(主要包括现金、银行存款、货币市场基金等)。大类资产配置策略包括三个层面：战略资产配置(SAA)，战术资产配置(TAA)，以及动态资产配置(DAA)。战略资产配置(SAA)层面，主要依据宏观经济的商业周期对各大类资产的配置约束做出初始的判断。战术资产配置(TAA)层面，通过不同类资产的短期趋势分析并结合量化模型分析，确定各大类资产的具体配置比例。在动态资产配置(DAA)层面，本基金将通过紧密跟踪市场，以防控突发风险为主，在必要时进行各类资产权重的调节。

(1) 战略资产配置(SAA)

主要根据宏观经济指标以及政策因素，对中国宏观经济所处的库存周期，货币周期，以及设备更新周期的相应阶段进行判定和识别。基于宏观经济处于以上各个周期的不同阶段，对权益类，固收类，以及流动性资产配置比例的大小关系进行确定和约束。这种确定和约束的有效性以6个月为周期，每6个月进行重新判定和调整。

(2) 战术资产配置(TAA)

综合考虑各宏观经济变量，政策因素，以及各类资产本身的投资逻辑与估值水平，利用不同类资产的量化指标或模型，对各类资产的短期趋势进行分析。同时，分析各类资产本身的风险收益特性分布，各类资产之间的相关性，日历效应等因素。利用以上分析结果所形成的主观判断结果，再利用“Black-litterman(B-L)”为基础的量化模型对各类资产的权重进行确定。量化模型通过融入主观的投资观点，来修正静态历史数据估计带来的预期偏差，使得投资组合更加逼近有效资产配置前沿的组合。其次，本基金还将利用战略资产配置层面的结论，对量化模型的优化进行约束，使得最终的战术资产配置结果与战略资产配置结果相匹配。

(3) 动态资产配置(DAA)

考虑到市场中的突发事件冲击，资产趋势的突然转变，以及市场波动突然

大幅提升等因素，本基金将对这类突发因素所造成的风险进行及时控制。一旦出现显著下行风险，将采用各种风控措施及时截断相关资产的下行风险，从而有效保护投资人的利益。

2、基金投资策略

本基金通过定量分析策略和定性分析策略相结合的方式优选标的基金，主要通过分析各标的基金的费率水平、历史收益、历史排名、夏普比率、历史回撤、波动率以及相应基金经理的择时、择券，稳定性等量化指标，挑选出合适的基金组成不同投资类型的标的基金池。再对标的基金池中的基金进行筛选和配置，通过深入了解标的基金的具体策略及投资领域，并对其基金管理人的历史、组织架构，以及标的基金基金经理的优势及稳定性进行分析，将资产分散投资于不同基金管理人、投资策略的基金，分别构建股票型基金投资组合、债券型基金投资组合以及货币型基金投资组合。

（1）定量分析策略

本基金对标的基金的收益和风险进行定量分析，选择成立时间较长或有较长的可回溯历史业绩的标的基金

业绩分析，分析基金在不同市场环境下的历史收益表现，主要包括历史收益、夏普比率和信息比率等指标，分析基金的收益表现是否和基金的投资目标、投资策略相符合，以及基金的择时、择券能力及投资风格等因素。

风险分析，主要分析基金的历史回撤、波动率以及下行风险等风险指标，选择总体投资风险水平适当可控的基金。

（2）定性分析策略

本基金主要从基金管理公司和基金经理两个角度对标的基金进行定性分析。

①主要考察基金管理公司的股东结构、历史业绩、监管表现、经营理念、管理规模、产品优势、投研架构、风控架构等因素。选择成立时间较长，组织架构较为稳定，资产规模较大，在行业内有一定的影响力的资产管理公司。

②重点考察基金经理的投资理念和投资优势、稳定性、从业经验、所管理

其他基金的状况等。选择基金经理投资理念和投资优势较为清晰，稳定性较高，从业经验丰富的基金经理。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

4、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 25\%$ 。

沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值，代表了沪深证券市场上大中小市值公司的整体状况，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数，能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

$\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 25\%$ 作为本基金的业绩比较基准比较符合本基金的风险收益特征，有利于投资者对本基金风险收益

特征进行判断。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者本基金业绩比较基准停止发布或变更名称，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人在与协商基金托管人一致后，可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金中基金，风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。

十二、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用以及投资其他基金的费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金管理人运用本基金财产申购其自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费

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

基金管理人对于基金财产中投资于本基金管理人管理的基金财产部分不收取管理费。

本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除持有本基金管理人管理基金财产部分后的余额的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除持有本基金管理人管理基金财产部分后的余额（若为负数，则 E 取 0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金托管人对于基金财产中投资于本基金托管人托管的基金财产部分不收取托管费。

本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除持有本基金托管人托管基金财产部分后的余额的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金托管人托管基金财产部分后的余额（若为负数，则 E 取 0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议

规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、对招募说明书更新部分的说明

诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）于2019年12月9日起生效，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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规的要求，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）依据中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新招募说明书“重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“四、基金托管人”、“五、相关服务机构”、“八、基金份额的申购与赎回”、“十一、基金资产的估值”、“十二、基金的收益与分配”、“十四、基金的会计与审计”、“十五、基金的信息披露”、“十七、基金合同的变更、终止和基金财产的清算”、“十八、基金合同的内容摘要”、“十九、基金托管协议的内容摘要”、“二十二、招募说明书的存放及查阅方式”相关内容。

(二) 在“重要提示”部分，增加了基金合同生效日以及招募说明书更新截止日期的描述。

(二) 在“三、基金管理人”中，对基金管理人的信息进行了更新。

(三) 在“四、基金托管人”中，对基金托管人的信息进行了更新。

(四) 在“五、相关服务机构”中，对代销机构信息进行了更新。

(五) 在“六、基金的募集”中，对基金募集的信息进行了更新。

(六) 在“七、基金合同的生效”中，对基金合同生效的信息进行了更新。

(七) 在“二十一、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

2020年1月22日