

诺德基金管理有限公司关于诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告

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》、《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，现将诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金（以下使用全称或其简称“本基金”）基金份额持有人大会的决议及相关事项公告如下：

一、基金份额持有人大会会议情况

诺德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以通讯方式组织召开了诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会，会议投票时间为自 2019 年 8 月 5 日起至 2019 年 9 月 3 日 17:00 止。2019 年 9 月 4 日，在本基金基金托管人招商证券股份有限公司授权代表的监督下，基金管理人对本次大会的表决情况进行了计票，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证，上海源泰律师事务所对计票过程进行了见证。本次表决的权益登记日为 2019 年 8 月 2 日。本次表决的计票结果如下：

参加本次大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所代表的基金份额共计 91,766,803.28 份，占权益登记日基金总份额 115,812,289.48 份的 79.24%。上述参加本次大会的本基金份额持有人所代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上，满足法定会议召开条件，符合《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》和《基金合同》的有关规定。

本次会议审议了《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”），并由参加本次大会的基金份额持有人（或其代理人）对本次会议议案进行表决，表决结果为：

同意票所代表的基金份额为 91,766,803.28 份，反对票所代表的基金份额为 0.00 份，弃权票所代表的基金份额为 0.00 份。同意票所代表的基金份额占参加本次大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所持总基金份额的 100%，达到参加大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上（含二分之一），满足法定生效条件，符合《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》和《基金合同》的有关规定，本次会议议案获得有效通过。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》的有关规定，经本基金托管人招商证券股份有限公司确认，本次基金份额持有人大会费用由基金资产列支，费用明细如下表：

项目 金额（单位：元）

律师费 20,000

公证费 10,000

合计 30,000

二、基金份额持有人大会决议生效情况

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于 2019 年 9 月 4 日表决通过了《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人将自该日起五日内将表决通过的事项报中国证监会备案。

三、基金份额持有人大会决议相关事项实施情况

1、关于本基金《基金合同》等法律文件的修订情况

根据《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人对《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》和《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金托管协议》进行了相应的修改，上述文件已获得中国证监会《关于准予诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金变更注

册的批复》（证监许可【2018】1764号）注册并将在诺德基金管理有限公司网站（www.nuodefund.com）更新。本基金管理人将按照相关规定在招募说明书中同步更新相关内容。

2、修订后的《基金合同》的生效

自本次基金份额持有人大会决议表决通过之日的次一工作日（即2019年9月5日）起，修订后的《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》生效，原《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

本次《基金合同》的具体修改内容详见附件2。

四、备查文件

1、《诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》；

2、《诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》；

3、《诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》；

4、上海源泰律师事务所出具的法律意见书；

5、上海市东方公证处出具的公证书。

特此公告。

诺德基金管理有限公司

二〇一九年九月五日

附件1:

上海市东方公证处出具的公证书

公证书

（2019）沪东证经字第12556号

申请人：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。

法定代表人：潘福祥。

委托代理人：罗丽娟，女，一九八二年三月二十四日出生。

公证事项：现场监督（基金份额持有人大会计票）

诺德基金管理有限公司作为诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金的基金管理人于二〇一九年八月二十三日向本处提出申请，对该公司以通讯方式召开的诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议的计票过程进行现场监督公证。

经查，申请人根据《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》的有关规定和诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金的基金合同的有关约定召开本次基金份额持有人大会。申请人依法于二〇一九年八月二日在有关报刊媒体上发布了以通讯方式召开本次基金份额持有人大会的公告；于二〇一九年八月五日、八月六日分别发布了召开本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告和第二次提示性公告，大会审议的事项为：《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。申请人向本处提交了该公司营业执照、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金的基金合同、召开基金份额持有人大会的公告、二次提示性公告、截至权益登记日登记在册的诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人名册等文件，申请人具有召开本次基金份额持有人大会的合法资格。

根据《中华人民共和国公证法》的规定，本处公证员林奇和公证人员印嘉琪于二〇一九年九月四日上午十时在中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼18层申请人的办公场所对诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的计票过程进行现场监督公证。

基金份额持有人大会对议案以通讯方式进行的表决，在该基金托管人招商证券股份有限公司委派的授权代表全金鑫、冯德诚的监督下，由诺德基金管理有限公司委派的代表王平、蒋彬彬进行计票。截至二〇一九年九月三日十七时，收到参加本次大会（通讯方式）的诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金

份额持有人有效表决所持基金份额共 91,766,803.28 份, 占二〇一九年八月二日权益登记日诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金总份额 115,812,289.48 份的 79.24%,达到法定开会条件, 符合《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》及诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金的基金合同的有关规定。大会对《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》的表决结果如下: 91,766,803.28 份基金份额表示同意; 0 份基金份额表示反对; 0 份基金份额表示弃权,同意本次议案的基金份额占参加本次大会的持有人所持基金份额的 100%, 达到法定条件, 符合《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》与诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金的基金合同的有关规定, 本次会议议案获得通过。

经审查和现场监督, 兹证明本次诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)对《关于修改诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》表决的计票过程符合有关法律规定和基金合同的约定, 表决结果符合会议议案的通过条件。

中华人民共和国上海市东方公证处

公证员林奇

二〇一九年九月四日

附件 2:

《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节 原《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》

同》
拟修订后的《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同(草案)》

第一部

分 前言

三、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集, 并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。

中国证监会对本基金募集申请的注册, 并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

.....

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。

三、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)就相关实质性内容的调整经中国证监会变更注册, 并于 2019 年 9 月 4 日, 经基金份额持有人大会审议通过。

中国证监会对本基金变更申请的注册, 并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

.....

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。本基金主要采用量化模

型构建股票投资组合，但不基于量化策略进行频繁交易。本基金在多个投资环节中采用量化策略，存在量化模型失效，导致基金业绩表现不佳的风险。

第二部

分 释义

7、基金份额发售公告：指《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金份额发售公告》 删除

15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

28、基金合同生效日：指变更注册后的《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》生效日期

31、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月 删除

39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 删除

54、A类基金份额：指在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、C类基金份额：指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

51、A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

52、C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

第三部

分 基金

的基本

情况

五、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

六、基金份额初始发售面值和认购费用

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费用按招募说明书的规定执行。

删除

八、基金份额的类别

本基金根据是否收取认购/申购费用及销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金资产净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

六、基金份额的类别

本基金根据是否收取申购费用及销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 CG 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金资产净值并单独公告。投资人可自行选择申购的基金份额类别。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

第四部

分 基金

的历史

沿革与

存续

第四部分 基金份额的发售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，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。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及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人。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。投资人认购A类基金份额时支付认购费用，认购C类基金份额时不支付认购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。A类基金份额的认购费用不列入基金财产。

2、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

4、认购份额余额的处理方式

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、认购申请的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。

4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，A

类基金份额的认购费用按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算。认购申请一经受理不允许撤销。

第五部分 基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

.....

第五部分

分 基金

份额的

申购与

赎回

三、申购与赎回的原则

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

三、申购与赎回的原则

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；对于由原诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金变更为本基金的基金份额，其持有期将从原基金份额取得之日起连续计算。

第六部
分 基金
合同当
事人及
权利义
务

一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会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；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，

基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

第七部

分 基金

份额持

有人大

会

一、召开事由

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(5) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

一、召开事由

2、在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(5) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

第十一

部分 基

金的投

资

二、投资范围

.....

本基金股票投资占基金资产的比例为 50%-95%；

权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%； 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者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。

二、投资范围

.....

本基金股票投资占基金资产的比例为 50%-95%，其中投资于本基金所界定的蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者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。

三、投资策略

2、股票投资策略

本基金采用“自下而上”的量化模型选择蓝筹股票，并辅以主动的基本面研判来进行风险防范。在实际投资过程中通过适时的调整模型，来优化股票投资组合，力求实现基金资产的长期稳健增值并且战胜业绩基准。

(1) 基础选股范围

蓝筹股是指市值规模较大 (总市值不低于 300 亿元)，且具有以下特征的股票：

- ①公司在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等；
- ②公司经营管理团队稳定、治理结构良好；
- ③公司财务指标健康、收入增长和盈利水平较高；
- ④市场估值相对于公司资产价值和增长潜力而言处于合理区间。

对中国证券市场中所有上市交易的 A 股股票按照以上特征进行筛选，将符合条件的股票纳入蓝筹股集合。

(2) 量化多因子选股

本基金通过量化多因子选股在蓝筹股集合中进行股票精选，实现“蓝筹增强”的股票投资策略。多因子模型已经被广泛的运用于股票投资组合管理。根据历史数据测算与统计，我们挑选出 3 大类主要因子，主要包括基本面类，技术行为类，以及事件驱动类等，来构建多因子选股模型。

具体而言.....

.....

利用高稳定性的最优因子组合对选股范围中的股票分别进行打分排序，再结合不同因子的权重，对所有股票进行综合排序。最后，选取得分较高的股票组成备选投资标的池。对于标的池中个股，管理人团队将根据公司投研团队进行主动研究或者现场调研的结果，将可能导致重大的投资风险的标的进行“主动型”剔除。根据业绩基准，对整个组合的市值、行业、估值和成长

等多个维度进行调整和校准，特别是，注重估值与行业的平衡。从而使得最终标的股票组合，真正达到稳定显著的增强效果。

三、投资策略

2、股票投资策略

本基金主要采用“自下而上”的量化模型构建股票投资组合，并辅以主动的基本面研判来进行风险防范。在实际投资过程中通过适时的调整模型，来优化股票投资组合，力求实现基金资产的长期稳健增值并且战胜业绩基准。

(1) 选股策略

1)核心选股策略

本基金重点投资于蓝筹股票，主要包括大盘蓝筹股、中盘蓝筹股等。

①大盘蓝筹股选择标准：

- a.市值规模较大(每半年对所有A股市场股票按照总市值从大到小进行排序，总市值规模在A股市场中排名前20%)；
- b.公司在行业中处于领先地位，具备竞争优势，比如专利技术、资源丰富、销售网络健全、独特的市场形象、较高的品牌认知度等；
- c.公司经营管理团队稳定、治理结构良好；
- d.公司财务指标（主要包括资产负债率、每股现金流、净利润等）健康、收入增长和盈利水平较高；
- e.市场估值（主要包括市盈率、市净率等）相对于公司资产价值和增长潜力而言处于合理区间。

②中盘蓝筹股选择标准：

基金管理人每半年对所有A股市场股票按照总市值从大到小进行排序，筛选出总市值规模在A股市场中排名处于20%到50%范围区间内的股票。在上述股票中，本基金将行业成长空间较大、公司在行业中已具有一定地位且具有竞争优势能够使得公司市场占有率不断提升、公司利润及净资产收益率具有持续稳定增长潜力的股票定义为中盘蓝筹股。

若未来由于市场环境或政策变化导致蓝筹股的覆盖范围发生变动，基金管理人可以适时对蓝筹股定义进行补充和修订并在更新的招募说明书中进行公告，无需召开基金份额持有人大会。

2) 其他选股策略

为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他优质上市公司发行的股票（非蓝筹股但具有成长为蓝筹股的潜力，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）。此类公司所属行业具有较大发展潜力，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，市场竞

争能力强，具备核心竞争优势及创新能力；同时公司具有优秀的治理结构，具备有清晰、合理的发展战略，管理层经验丰富，团结高效；并且公司财务状况良好，公司的盈利能力及业绩持续快速增长。本基金管理人通过对市场的深入研究和分析，筛选出有望成长为蓝筹股的优质上市公司股票，把握上市公司成长带来的投资机会。

（2）投资组合的优化

本基金通过量化多因子模型对股票组合进一步进行精选，主要基于对证券市场及上市公司相关数据（主要包括基本面类、技术行为类、事件驱动类等因子数据）的挖掘，寻找最优的上市公司进入备选投资标的池，并辅以主动研判构建最终投资组合，以期达到“收益增强”的效果。

具体而言……

……

利用高稳定性的最优因子组合对投资组合中的股票分别进行打分排序，再结合不同因子的权重，对所有股票进行综合排序。最后，选取得分较高的股票组成备选投资标的池。对于标的池中个股，管理人团队将根据公司投研团队进行主动研究或者现场调研的结果，将可能导致重大的投资风险的目标进行“主动型”剔除。根据业绩基准，对整个组合的市值、行业、估值和成长等多个维度进行调整和校准，特别是，注重估值与行业的平衡。从而使得最终标的股票组合，真正达到稳定显著的增强效果。

四、投资限制

1、组合限制

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 95%；

四、投资限制

1、组合限制

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 50% - 95%，其中投资于本基金所界定的蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

六、风险收益特征

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

第十六

部分 基

金的会
计与审
计

一、基金会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

一、基金会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

第十七

部分 基

金的信

息披露

五、公开披露的基金信息

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……

3、……

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；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网站上。

五、公开披露的基金信息

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……

3、……

基金变更注册事宜的基金份额持有人大会决议表决通过后，基金管理人应将经中国证监会注册的基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；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网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次

日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

（二）基金合同生效公告

基金管理人应当在指定媒介上登载基金合同生效公告。

（七）临时报告

7、基金募集期延长：

（六）临时报告

删除

第二十

一部分

基金合

同的效

力

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签署或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签署或签章并经中国证监会注册后，经基金份额持有人大会就基金变更注册事宜表决通过，自 2019 年 9 月 5 日起变更后的《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》生效，原《诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

基金合同内容摘要部分、托管协议、招募说明书根据基金合同正文的修改相应调整。