

诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 27 日

送出日期：2024 年 6 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金简称 | 诺德研发创新 100 | 基金代码 | 007737 |
| 基金管理人 | 诺德基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 8 月 26 日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 契约型开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 潘永昌 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019 年 8 月 26 日 |
| | | 证券从业日期 | 2016 年 4 月 11 日 |

二、基金投资与净值表现

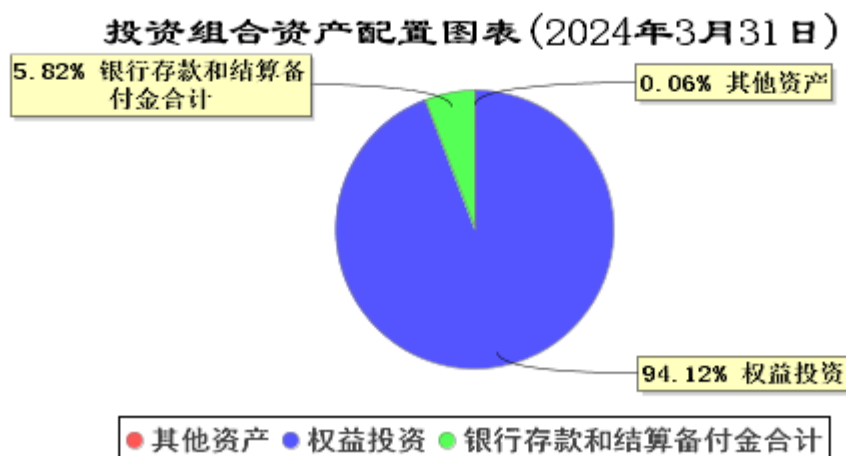
(一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《招募说明书》第九章“基金的投资”章节了解详细情况。

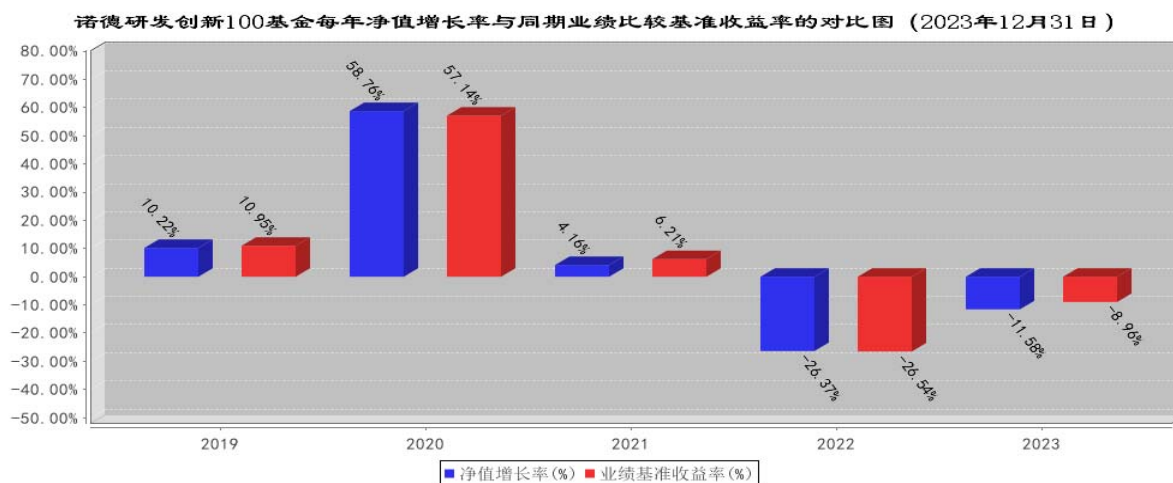
| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证研发创新 100 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 |
| 投资范围 | <p>本基金主要投资于标的指数（中证研发创新 100 指数）成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于其他具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货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（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除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。</p> <p>本基金参与股指期货、国债期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> |

| | |
|--------|---|
| | 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。 |
| 主要投资策略 | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证研发创新 100 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金成立于 2019 年 8 月 26 日，合同生效当年按实际期限计算净值增长率与业绩基准收益率。净值增长率及业绩基准收益率截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
|------|-----------------------------|---------|

| | | |
|--------------|-------------------------------|-----------|
| 申购费 (前收费) | M < 1,000,000 元 | 1.5% |
| | 1,000,000 元 ≤ M < 5,000,000 元 | 1.0% |
| | M ≥ 5,000,000 元 | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% |
| | 7 天 ≤ N < 180 天 | 0.1% |
| | N ≥ 180 天 | 0.0 |

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | | 收取方 |
|---------|--|------------------------|------------|
| 管理费 | 0.80% | | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.10% | | 基金托管人 |
| 审计费用 | 60,000.00 元 | | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 0.02% | 年下限金额： 200,000.00 元 | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用、以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》更新。 | | 相关服务机构 |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.00% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

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，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用

风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、基金估值风险、本基金的特定风险、其他风险等等。

本基金的特定风险：（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。（2）标的指数波动的风险。（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险（5）标的指数变更的风险。（6）指数编制机构停止服务的风险。（7）成份股停牌的风险。（8）金融衍生品投资风险，包括但不限于市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险、杠杆投资风险、不适当估值风险、强制平仓风险等。（9）本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。（10）投资科创板特有风险，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

（二）重要提示

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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实守信、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。

基金投资者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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

本基金争议解决方式为仲裁。因基金合同产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【www.nuodefund.com】【400-888-0009】

1、《诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金基金合同》、《诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金托管协议》、《诺德中证研发创新 100 指数型证券投资基金招募说明书》

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料