

诺德深证 300 指数分级证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 年 6 月 30 日

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

报告送出日期：二〇一五年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 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贵金属投资明细.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
9 开放式基金份额变动.....	50
10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德深证 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	诺德 S300		
场内简称	诺德 S300		
基金主代码	165707		
交易代码	165707		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 10 日		
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		
报告期末基金份额总额	32,218,874.01 份		
上市日期	2012 年 9 月 24 日		
下属分级基金的基金简称	诺德 300A	诺德 300B	诺德 S300
下属分级基金的交易代码	150092	150093	165707
报告期末下属分级基金的份额总额	11,436,205.00 份	11,436,205.00 份	9,346,464.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争将本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的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对深证 300 指数的有效跟踪，分享中国经济的持续、稳定增长的成果，实现基金资产的长期增值。		
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制指数的投资方法，按照成份股在深证 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，以拟合、跟踪深证 300 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证 300 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率×95% + 金融同业存款利率×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	诺德深证 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	诺德深证 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。	诺德深证 300 份额为常规指数基金份额，具有较高风险、较高预期收益的特征。长期平均的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。
--	--	--	-----------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺德基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张欣	王永民
	联系电话	021-68879999	010-66594896
	电子邮箱	xin.zhang@nuodefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68877727	010-66594942
注册地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海浦东新区陆家嘴环路1233号1201室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨忆风	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	12,427,734.92
本期利润	10,431,310.27
加权平均基金份额本期利润	0.4613
本期加权平均净值利润率	36.22%
本期基金份额净值增长率	54.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)

期末可供分配利润	16,306,674.34
期末可供分配基金份额利润	0.5061
期末基金资产净值	31,295,052.25
期末基金份额净值	0.971
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	108.81%

注：1、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、 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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3、 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-11.41%	3.59%	-10.34%	3.46%	-1.07%	0.13%
过去三个月	15.86%	2.61%	15.45%	2.62%	0.41%	-0.01%
过去六个月	54.07%	2.14%	49.44%	2.12%	4.63%	0.02%
过去一年	101.82%	1.65%	100.55%	1.67%	1.27%	-0.02%
自基金合同生效起至今	108.81%	1.41%	105.09%	1.43%	3.72%	-0.02%

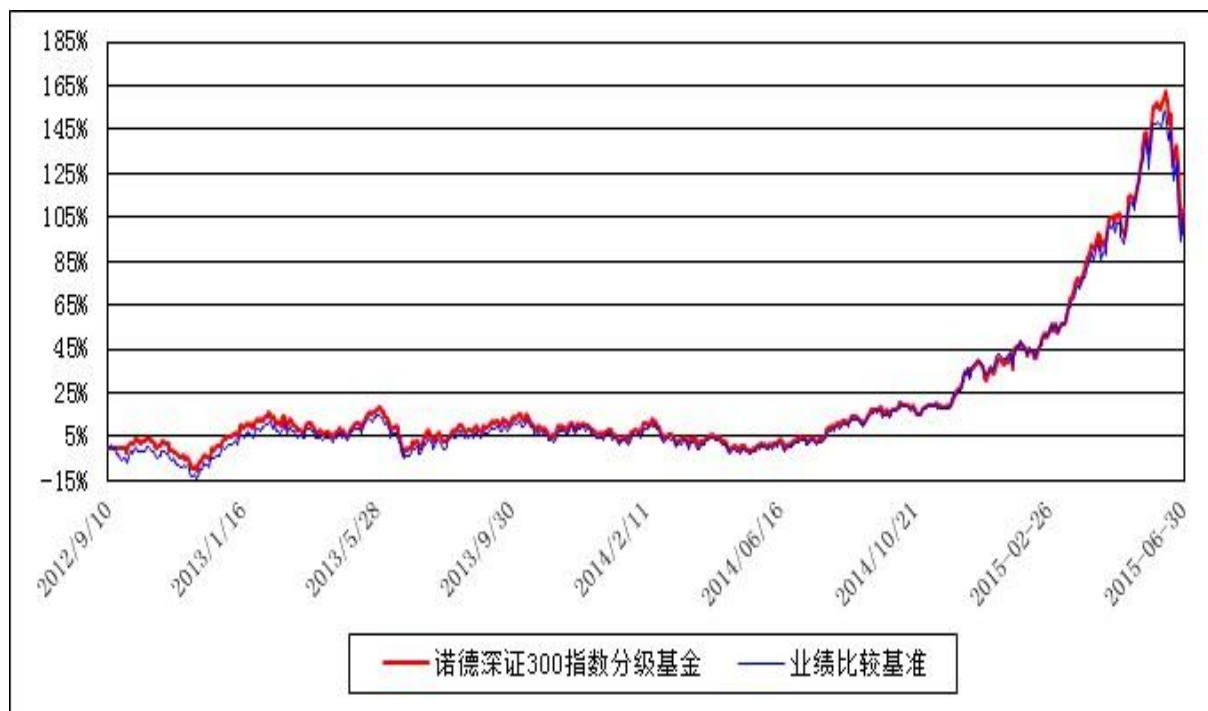
注：业绩比较基准=深证 300 价格指数收益率*95%+金融同业存款利率*5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

诺德深证 300 指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012 年 9 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日）



注：“诺德深证 300 指数分级证券投资基金成立于 2012 年 9 月 10 日，图示时间段为 2012 年 9 月 10 日至 2015 年 06 月 30 日。

本基金建仓期间自 2012 年 9 月 10 日至 2012 年 3 月 9 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。”

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88 号文批准设立。公司股东为诺德·安博特资产管理公司 (Lord, Abnett & Co., LLC)、长江证券股份有限公司、清华控股有限公司，注册地为上海，注册资本为 1 亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了九只开放式基金：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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
胡洋	本基金基金经理	2014-05-29	-	7	清华大学国际工商管理硕士, 2008 年 6 月加入诺德基金管理有限公司, 在投资研究部从事投资管理相关工作, 历任研究员及基金经理助理职务, 具有 6 年以上从事投资管理工作的经历。

注：任职日期是指本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期；证券从业的含义遵守行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。此外，本基金管理人还建立了公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金未有参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,我们根据自行开发的指数基金管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式,处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理等事件,使得本基金的年化波动率控制在与业绩基准基本相当的水平。

报告期内,本基金遵循被动化指数投资策略,努力控制净值表现与业绩基准的偏差.从实际效果来看,报告期内本基金与业绩基准收益的偏差主要来源于股票分红、停牌复牌、三位小数净值四舍五入等原因所带来的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 0.971 元,累计净值为 2.077 元。本报告期份额净值增长率为 54.07%,同期业绩比较基准增长率为 49.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标,期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为了确保基金估值严格执行新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,更好地保护基金份额持有人的合法权益,基金管理人制定并修订了《诺德基金管理有限公司证券投资基金估值制度》(以下简称“估值制度”。)

根据估值制度,基金管理人设立了专门的估值委员会。估值委员会由公司投资总监、运营总监、清算登记部经理、基金会计主管和法务主管组成,所有相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历。估值委员会主要负责制定基金资产的估值政策和程序,定期评价现有估值政策和程序的适用性以及保证估值策略和程序的一致性。其中:

基金会计主管主要负责制定新的估值政策、方法和程序,提供相关的会计数据,并具体负责和会计事务所及基金托管行就估值模型、假设及参数进行沟通,以支持委员会的相关决定;

运营总监及清算登记部经理主要负责监督估值委员会决议有效执行及实施;

投资总监主要负责分析市场情况,并在结合相关行业研究员意见的基础上对具体投资品种所处的经济环境和相关重大事项进行判断;

法务主管负责审核委员会决议的合法合规性,以及负责具体信息披露工作。

根据估值制度，估值委员会成员中不包括基金经理。本报告期内，上述参与流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金曾连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诺德深证 300 指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺德深证 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,790,571.64	202,861.97
结算备付金		733,377.69	26,094.47
存出保证金		34,396.43	16,331.40
交易性金融资产	6.4.7.2	30,359,056.89	24,136,752.03
其中：股票投资		29,324,105.89	22,707,540.03
基金投资		-	-
债券投资		1,034,951.00	1,429,212.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,391,196.00	99,949.46
应收利息	6.4.7.5	26,907.37	18,834.67
应收股利		-	-
应收申购款		145,981.87	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		35,481,487.89	24,500,824.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		300,000.00	200,000.00
应付证券清算款		400,033.25	-
应付赎回款		3,050,383.61	201,572.67
应付管理人报酬		47,917.84	23,364.58
应付托管费		9,583.60	4,672.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	151,181.37	67,729.77
应交税费		-	-
应付利息		16.42	7.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,319.55	480,759.70
负债合计		4,186,435.64	978,107.04
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	14,988,377.91	17,367,618.51
未分配利润	6.4.7.10	16,306,674.34	6,155,098.45

所有者权益合计		31,295,052.25	23,522,716.96
负债和所有者权益总计		35,481,487.89	24,500,824.00

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.971 元，基金份额总额 32,218,874.01 份。

6.2 利润表

会计主体：诺德深证 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		11,025,269.30	-1,326,437.52
1.利息收入		30,675.89	35,020.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,764.79	7,289.85
债券利息收入		18,911.10	27,323.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	407.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,861,203.27	-318,841.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,741,732.27	-822,402.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,167.40	3,013.63
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	118,303.60	500,547.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,996,424.65	-1,052,190.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	129,814.79	9,573.57
减：二、费用		593,959.03	819,439.52
1. 管理人报酬		139,126.41	271,615.89
2. 托管费		27,825.35	54,323.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	282,301.11	82,744.91
5. 利息支出		2,840.50	4,946.64
其中：卖出回购金融资产支出		2,840.50	4,946.64
6. 其他费用	6.4.7.19	141,865.66	405,808.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,431,310.27	-2,145,877.04
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,431,310.27	-2,145,877.04
-------------------	--	---------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺德深证 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	17,367,618.51	6,155,098.45	23,522,716.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,431,310.27	10,431,310.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,379,240.60	-279,734.38	-2,658,974.98
其中：1.基金申购款	45,941,706.67	58,111,489.50	104,053,196.17
2.基金赎回款	-48,320,947.27	-58,391,223.88	-106,712,171.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,988,377.91	16,306,674.34	31,295,052.25
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	57,465,922.61	4,455,289.16	61,921,211.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,145,877.04	-2,145,877.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,444,851.02	-572,428.33	-7,017,279.35
其中：1.基金申购款	1,168,942.82	57,591.49	1,226,534.31
2.基金赎回款	-7,613,793.84	-630,019.82	-8,243,813.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	51,021,071.59	1,736,983.79	52,758,055.38

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：潘福祥，主管会计工作负责人：潘福祥，会计机构负责人：高奇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺德深证 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]551 号《关于核准诺德深证 300 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由诺德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 496,955,609.46 元，业经普华永道中天验字(2012)第 325 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 497,426,677.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 471,067.87 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)的有关规定，深证 300 分级基金的基金份额包括诺德深证 300 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“诺德 S300 份额”，基金代码“165707”)、诺德深证 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“诺德 300A 份额”，基金代码“150092”)与诺德深证 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“诺德 300B 份额”，基金代码“150093”)。在诺德 300A 份额、诺德 300 份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算，每 2 份诺德 S300 份额按照 1 份诺德 300A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。其中，诺德 300A 份额和诺德 300B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。另外，本基金还将在以下两种情况根据基金合同进行份额折算，即：当诺德 S300 份额的基金份额净值达到 2.000 元，或当诺德 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第 303 号文审核同意,本基金诺德 A(150092) 33,855,603.00 份基金份额和诺德 B(150093) 33,855,603.00 份基金份额于 2012 年 9 月 24 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》和最新公布的《诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括深证 300 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、固定收益产品、权证、股指期货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。本基金的投资组合比例为:所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于深证 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。本基金业绩比较基准:深证 300 价格指数收益率 \times 95%+金融同业存款利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期会计报表所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金未发生会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金未发生会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,790,571.64
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,790,571.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	29,789,305.20	29,324,105.89	-465,199.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,030,634.00	1,034,951.00	4,317.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,030,634.00	1,034,951.00	4,317.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	30,819,939.20	30,359,056.89	-460,882.31	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未从事买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	503.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	330.02
应收债券利息	26,057.71
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.40
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.50
合计	26,907.37

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他各项资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	151,181.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	151,181.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	10,645.91
应付指数使用费	2,782.51
预提费用	213,891.13
合计	227,319.55

6.4.7.9 实收基金

诺德 300A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	6,178,047.00	6,178,047.00
本期申购	5,258,158.00	5,258,158.00
本期末	11,436,205.00	11,436,205.00

诺德 300B

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	6,178,047.00	6,178,047.00
本期申购	5,258,158.00	5,258,158.00
本期末	11,436,205.00	11,436,205.00

诺德 S300 金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,655,482.50	5,011,524.51
本期折算	22,272,865.53	
本期拆分	-10,516,316.00	-10,516,316.00
本期申购	82,381,882.16	45,941,706.67
本期赎回（以“-”号填列）	-90,447,450.18	-48,320,947.27
本期末	9,346,464.01	-7,884,032.09

注：1.根据《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》第二十四条基金份额折算的相关规定，当诺德深证 300 指数分级证券投资基金之基础份额（诺德深证 300 份额）的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将分别对诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的份额数比例为 1：1，份额折算后诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值、诺德深证 300 份额净值均调整为 1.000 元。

2.根据《关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的管理人诺德基金管理有限公司确定以 2015 年 5 月 13 日为折算基准日。折算前，诺德深证 300 份额净值 2.026 元，诺德深证 300 场外份额 2,978,906.29 份，诺德深证 300 场内份额 4,391,277.00 份；诺德深证 300A 份额净值 1.021 元，诺德深证 300A 份额 6,968,704.00 份；诺德深证 300B 份额净值 3.032 元，诺德深证 300B 份额 6,968,704.00 份。折算后，诺德深证 300 份额净值 1.000 元，诺德深证 300 场外份额 6,036,212.30 份，诺德深证 300 场内份额 23,202,343.00 份；诺德深证 300A 份额净值 1.000 元，诺德深证 300A 份额 6,968,704.00 份；诺德深证 300B 份额净值 1.000 元，诺德深证 300B 份额 6,968,704.00 份。本基金的注册登记人中国证券登记结算有限责任公司已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并进行了变更登记。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,234,384.80	-2,079,286.35	6,155,098.45
本期利润	12,427,734.92	-1,996,424.65	10,431,310.27
本期基金份额交易产生的变动数	-4,203,503.28	3,923,768.90	-279,734.38
其中：基金申购款	35,065,745.03	23,045,744.47	58,111,489.50
基金赎回款	-39,269,248.31	-19,121,975.57	-58,391,223.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,458,616.44	-151,942.10	16,306,674.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,883.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,647.26
其他	234.03
合计	11,764.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	93,915,357.49
减：卖出股票成本总额	81,173,625.22
买卖股票差价收入	12,741,732.27

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	412,425.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	400,000.00
减：应收利息总额	11,257.97
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）	1,167.40

差价收入	
------	--

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	118,303.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	118,303.60

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-1,996,424.65
——股票投资	-2,002,163.65
——债券投资	5,739.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,996,424.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	129,814.79
合计	129,814.79

注：1. 本基金的场外赎回费率不高于 0.5%，随基金份额持有期限的增加而递减；本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。其中赎回费部分全额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	282,301.11
银行间市场交易费用	-
合计	282,301.11

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	74,385.57
银行费用	5,192.02
基金上市费	29,752.78
指数使用费	2,782.51
合计	141,865.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
长江证券股份有限公司("长江证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
Lord, Abnett & Co. LLC	基金管理人的股东
清华控股有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	139,126.41	271,615.89
其中：支付销售机构的客户维护费	16,299.00	79,771.21

注：支付基金管理人诺德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,825.35	54,323.21

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,790,571.64	9,883.50	1,689,729.37	6,631.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金未发生其他需要说明的关联方交易。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	31.64	-	-	3,035.00	56,281.54	96,027.40	-
000539	粤电力A	2015-06-08	非公开发行	11.94	2015-07-21	10.75	11,400.00	102,098.64	136,116.00	-
000543	皖能电力	2015-06-15	重大事项	21.36	2015-07-14	19.22	4,900.00	82,146.85	104,664.00	-

000566	海南海药	2015-06-18	重大事项	49.97	-	-	3,200.00	141,205.28	159,904.00	-
000592	平潭发展	2015-06-30	筹划员工持股计划	29.76	2015-07-14	30.00	3,400.00	95,786.91	101,184.00	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	重大事项	8.44	-	-	3,938.00	28,189.32	33,236.72	-
000693	华泽钴镍	2015-06-30	重大事项	20.57	2015-08-18	22.63	300.00	7,440.00	6,171.00	-
000697	炼石有色	2015-05-18	重大事项	33.83	-	-	1,600.00	41,428.00	54,128.00	-
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	25,200.00	125,837.80	176,400.00	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	34.88	-	-	4,900.00	152,684.18	170,912.00	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	非公开发行	12.96	-	-	18,844.00	139,372.56	244,218.24	-
000786	北新建材	2015-04-10	重大事项	18.58	-	-	2,000.00	23,791.38	37,160.00	-
000788	北大医药	2015-05-25	重大资产重组	20.72	2015-07-21	18.65	2,700.00	50,214.51	55,944.00	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	20.75	-	-	8,551.00	132,800.09	177,433.25	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	6,287.00	127,345.30	148,184.59	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	24.50	-	-	8,807.00	164,345.94	215,771.50	-
000887	中鼎股份	2015-06-30	重大资产重组	24.75	-	-	3,541.00	101,726.74	87,639.75	-
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	30.81	-	-	9,622.00	276,495.68	296,453.82	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	62.50	2015-08-05	69.20	1,426.00	101,546.43	89,125.00	-
000979	中弘股份	2015-05-25	重大事项	6.04	-	-	12,464.00	53,303.17	75,282.56	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	8.93	-	-	17,620.00	82,216.56	157,346.60	-
001696	宗申动力	2015-06-30	重大事项	17.25	2015-08-24	15.53	4,691.00	108,979.98	80,919.75	-
002001	新和成	2015-06-30	筹划员工持股计划	17.09	2015-07-13	18.49	3,152.00	63,696.38	53,867.68	-
002069	獐子岛	2015-06-01	非公开发行	19.76	-	-	4,642.00	85,916.63	91,725.92	-

002091	江苏国泰	2015-06-01	重大事项	26.22	-	-	3,900.00	88,691.11	102,258.00	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大资产重组	16.42	-	-	1,315.00	18,222.26	21,592.30	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事项	65.78	-	-	11,060.00	588,459.04	727,526.80	-
002191	劲嘉股份	2015-06-18	重大事项	19.22	-	-	6,318.00	95,080.80	121,431.96	-
002203	海亮股份	2015-04-27	重大事项	12.71	-	-	1,100.00	9,207.46	13,981.00	-
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	重大事项	67.20	2015-07-13	60.48	1,840.00	87,231.55	123,648.00	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大事项	19.45	2015-07-07	17.51	2,324.00	37,410.06	45,201.80	-
002269	美邦服饰	2015-05-22	重大事项	11.86	2015-07-02	10.67	8,200.00	65,586.51	97,252.00	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.85	-	-	2,200.00	45,379.19	83,270.00	-
002310	东方园林	2015-05-27	重大事项	38.30	-	-	3,300.00	87,737.64	126,390.00	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	35.05	-	-	2,930.00	110,310.04	102,696.50	-
002368	太极股份	2015-05-14	重大事项	52.73	-	-	1,350.00	57,061.64	71,185.50	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	筹划员工持股计划	23.96	2015-07-20	26.29	3,957.00	95,614.64	94,809.72	-
002414	高德红外	2015-05-13	重大事项	39.36	-	-	1,045.00	29,976.04	41,131.20	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项	20.67	2015-07-29	18.60	909.00	15,219.41	18,789.03	-
002577	雷柏科技	2015-06-10	重大事项	80.60	-	-	1,000.00	59,569.22	80,600.00	-
300074	华平股份	2015-06-29	非公开发行	15.39	2015-07-14	16.00	1,280.00	14,646.29	19,699.20	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大事项	56.66	2015-07-20	68.82	1,600.00	117,228.80	90,656.00	-
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	59.94	2015-07-13	54.00	1,260.00	82,904.88	75,524.40	-
300228	富瑞特装	2015-06-24	非公开发行	79.76	2015-07-30	81.82	811.00	72,295.63	64,685.36	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 300,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行被动投资的股票型指数基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：(1)决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；(2)执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3)监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、监察稽核部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,034,951.00	-
合计	1,034,951.00	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,790,571.64	-	-	-	-	-	1,790,571.64
结算备付金	733,377.69	-	-	-	-	-	733,377.69
存出保证金	34,396.43	-	-	-	-	-	34,396.43
交易性金融资产	0.00	200,220.00	834,731.00	-	-	29,324,105.89	30,359,056.89
应收证券清算	-	-	-	-	-	2,391,196.0	2,391,196.0

款						0	0
应收利息	-	-	-	-	-	26,907.37	26,907.37
应收申购款	-	-	-	-	-	145,981.87	145,981.87
资产总计	2,558,345.76	200,220.00	834,731.00	-	-	31,888,191.13	35,481,487.89
负债							
卖出回购金融资产款	300,000.00	-	-	-	-	-	300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	400,033.25	400,033.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,050,383.61	3,050,383.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,917.84	47,917.84
应付托管费	-	-	-	-	-	9,583.60	9,583.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	151,181.37	151,181.37
应付利息	-	-	-	-	-	16.42	16.42
其他负债	-	-	-	-	-	230,102.06	230,102.06
负债总计	300,000.00	-	-	-	-	3,889,218.15	4,189,218.15
利率敏感度缺口	2,258,345.76	200,220.00	834,731.00	-	-	27,998,972.98	31,292,269.74
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	202,861.97	-	-	-	-	-	202,861.97
结算备付金	26,094.47	-	-	-	-	-	26,094.47
存出保证金	16,331.40	-	-	-	-	-	16,331.40
交易性金融资产	-	-	1,429,212.00	-	-	22,707,540.03	24,136,752.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	99,949.46	99,949.46
应收利息	-	-	-	-	-	18,834.67	18,834.67
资产总计	245,287.84	-	1,429,212.00	-	-	22,826,324.16	24,500,824.00
负债							
卖出回购金融	200,000.00	-	-	-	-	-	200,000.00

资产款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	201,572.67	201,572.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,364.58	23,364.58
应付托管费	-	-	-	-	-	4,672.91	4,672.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	67,729.77	67,729.77
应付利息	-	-	-	-	-	7.41	7.41
其他负债	-	-	-	-	-	480,759.70	480,759.70
负债总计	200,000.00	-	-	-	-	778,107.04	978,107.04
利率敏感度缺口	45,287.84	-	1,429,212.00	-	-	22,048,217.12	23,522,716.96

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	-
	市场利率上升 25 个基点	增加约 0	-

注：于 2015 年 06 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的 6.08%(2014 年 12 月 31 日：6.08%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。(2014 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临

的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；债券及其他货币市场工具占基金资产的 0-35%；保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,324,105.89	93.70	22,707,540.03	96.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,034,951.00	3.31	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,359,056.8	97.01	22,707,540.03	96.53

	9			
--	---	--	--	--

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 深证 300 指数上升 5%	增加约 144	增加约 85
2. 深证 300 指数下降 5%	减少约 144	减少约 85	

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	29,324,105.89	82.65
	其中：股票	29,324,105.89	82.65
2	固定收益投资	1,034,951.00	2.92
	其中：债券	1,034,951.00	2.92
	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	2,523,949.33	7.11
7	其他各项资产	2,598,481.67	7.32
8	合计	35,481,487.89	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	482,119.92	1.54
B	采矿业	616,793.64	1.97
C	制造业	16,279,900.48	52.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	664,270.53	2.12
E	建筑业	496,646.61	1.59
F	批发和零售业	1,034,700.34	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	53,836.32	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,106,278.22	9.93
J	金融业	2,332,697.38	7.45
K	房地产业	1,671,622.10	5.34
L	租赁和商务服务业	1,175,109.94	3.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	571,370.68	1.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,519.52	0.18
R	文化、体育和娱乐业	644,201.05	2.06
S	综合	118,019.16	0.38
	合计	29,304,085.89	93.64

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	20,020.00	0.06
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	20,020.00	0.06

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	12,888	823,543.20	2.63
2	002183	怡亚通	11,060	727,526.80	2.32
3	000002	万科A	47,755	693,402.60	2.22
4	000001	平安银行	35,414	514,919.56	1.65
5	000333	美的集团	11,480	427,974.40	1.37
6	000776	广发证券	18,721	424,030.65	1.35
7	300059	东方财富	6,248	394,186.32	1.26
8	002024	苏宁云商	22,751	348,090.30	1.11
9	002673	西部证券	12,048	341,801.76	1.09
10	002415	海康威视	7,404	331,699.20	1.06
11	000166	申万宏源	19,317	313,901.25	1.00
12	000858	五粮液	9,867	312,783.90	1.00
13	000917	电广传媒	9,622	296,453.82	0.95
14	000725	京东方A	52,800	274,032.00	0.88
15	000768	中航飞机	6,287	273,987.46	0.88

16	000063	中兴通讯	10,378	247,100.18	0.79
17	000778	新兴铸管	18,844	244,218.24	0.78
18	000625	长安汽车	11,540	244,071.00	0.78
19	000100	TCL 集团	42,700	241,255.00	0.77
20	000069	华侨城 A	18,463	239,649.74	0.77
21	300104	乐视网	4,406	228,054.56	0.73
22	000728	国元证券	5,812	220,739.76	0.71
23	000878	云南铜业	8,807	215,771.50	0.69
24	300024	机器人	2,664	205,820.64	0.66
25	002450	康得新	6,452	197,431.20	0.63
26	000538	云南白药	2,275	196,264.25	0.63
27	000338	潍柴动力	6,180	195,658.80	0.63
28	000503	海虹控股	3,876	189,924.00	0.61
29	000157	中联重科	23,185	188,030.35	0.60
30	000793	华闻传媒	8,551	177,433.25	0.57
31	300168	万达信息	3,600	176,832.00	0.57
32	000709	河北钢铁	25,200	176,400.00	0.56
33	300027	华谊兄弟	4,520	172,392.80	0.55
34	000748	长城信息	4,900	170,912.00	0.55
35	002202	金风科技	8,759	170,537.73	0.54
36	002594	比亚迪	3,000	165,690.00	0.53
37	000423	东阿阿胶	2,989	162,900.50	0.52
38	000566	海南海药	3,200	159,904.00	0.51
39	002230	科大讯飞	4,550	158,977.00	0.51
40	000982	中银绒业	17,620	157,346.60	0.50
41	000039	中集集团	4,756	153,618.80	0.49
42	300070	碧水源	3,117	152,078.43	0.49
43	000970	中科三环	7,210	148,598.10	0.47
44	000839	中信国安	6,287	148,184.59	0.47
45	002142	宁波银行	6,949	146,971.35	0.47
46	002241	歌尔声学	4,081	146,507.90	0.47
47	000559	万向钱潮	6,630	144,931.80	0.46
48	002081	金螳螂	5,007	141,147.33	0.45
49	002304	洋河股份	2,031	140,870.16	0.45
50	000402	金融街	9,912	140,056.56	0.45
51	000060	中金岭南	7,404	137,640.36	0.44
52	000021	深科技	8,951	136,502.75	0.44
53	000539	粤电力 A	11,400	136,116.00	0.43
54	002104	恒宝股份	5,710	135,269.90	0.43
55	002465	海格通信	4,200	135,198.00	0.43
56	000623	吉林敖东	4,005	134,568.00	0.43
57	002008	大族激光	4,613	132,485.36	0.42
58	002065	东华软件	4,424	127,190.00	0.41
59	000568	泸州老窖	3,896	127,048.56	0.41

60	002310	东方园林	3,300	126,390.00	0.40
61	002405	四维图新	2,840	124,392.00	0.40
62	000686	东北证券	6,378	124,179.66	0.40
63	000540	中天城投	9,817	123,694.20	0.40
64	002223	鱼跃医疗	1,840	123,648.00	0.40
65	300017	网宿科技	2,655	123,245.10	0.39
66	002191	劲嘉股份	6,318	121,431.96	0.39
67	000009	中国宝安	7,236	118,019.16	0.38
68	000425	徐工机械	8,672	115,077.44	0.37
69	002456	欧菲光	3,402	114,783.48	0.37
70	000629	攀钢钒钛	21,100	113,096.00	0.36
71	000800	一汽轿车	4,534	112,805.92	0.36
72	000895	双汇发展	5,251	112,003.83	0.36
73	300058	蓝色光标	6,865	108,535.65	0.35
74	000826	桑德环境	2,759	107,297.51	0.34
75	000750	国海证券	6,380	107,184.00	0.34
76	000876	新希望	5,430	105,396.30	0.34
77	002030	达安基因	2,376	105,256.80	0.34
78	000543	皖能电力	4,900	104,664.00	0.33
79	300124	汇川技术	2,173	104,304.00	0.33
80	002129	中环股份	5,200	102,908.00	0.33
81	002353	杰瑞股份	2,930	102,696.50	0.33
82	002091	江苏国泰	3,900	102,258.00	0.33
83	300003	乐普医疗	2,505	101,627.85	0.32
84	002500	山西证券	5,600	101,304.00	0.32
85	000592	平潭发展	3,400	101,184.00	0.32
86	000031	中粮地产	5,349	101,042.61	0.32
87	300253	卫宁软件	1,917	99,684.00	0.32
88	000598	兴蓉投资	10,340	98,953.80	0.32
89	002400	省广股份	3,900	98,514.00	0.31
90	002252	上海莱士	1,500	98,160.00	0.31
91	000998	隆平高科	3,618	98,047.80	0.31
92	002269	美邦服饰	8,200	97,252.00	0.31
93	000581	威孚高科	3,114	96,502.86	0.31
94	000792	盐湖股份	3,400	96,492.00	0.31
95	002022	科华生物	2,259	96,368.94	0.31
96	000024	招商地产	3,035	96,027.40	0.31
97	000012	南玻 A	7,185	95,847.90	0.31
98	002236	大华股份	2,999	95,728.08	0.31
99	002375	亚厦股份	3,957	94,809.72	0.30
100	002475	立讯精密	2,800	94,668.00	0.30
101	000061	农产品	4,600	93,840.00	0.30
102	000690	宝新能源	7,400	93,610.00	0.30
103	000883	湖北能源	10,700	93,304.00	0.30

104	000046	泛海控股	6,293	92,192.45	0.29
105	002069	獐子岛	4,642	91,725.92	0.29
106	300079	数码视讯	3,269	90,845.51	0.29
107	000831	五矿稀土	3,546	90,706.68	0.29
108	300144	宋城演艺	1,600	90,656.00	0.29
109	000997	新大陆	3,398	90,386.80	0.29
110	002153	石基信息	692	89,953.08	0.29
111	002385	大北农	6,623	89,542.96	0.29
112	000738	中航动控	2,700	89,532.00	0.29
113	000963	华东医药	1,426	89,125.00	0.28
114	000400	许继电气	3,518	88,512.88	0.28
115	002312	三泰控股	2,355	88,218.30	0.28
116	002410	广联达	3,750	87,750.00	0.28
117	000887	中鼎股份	3,541	87,639.75	0.28
118	000960	锡业股份	4,318	87,007.70	0.28
119	002038	双鹭药业	1,525	86,391.25	0.28
120	000825	太钢不锈	12,100	86,031.00	0.27
121	000027	深圳能源	6,959	85,943.65	0.27
122	000413	东旭光电	8,700	85,086.00	0.27
123	002152	广电运通	2,624	84,860.16	0.27
124	002004	华邦颖泰	6,500	84,370.00	0.27
125	000901	航天科技	1,280	84,160.00	0.27
126	300147	香雪制药	2,710	83,468.00	0.27
127	300002	神州泰岳	5,465	83,286.60	0.27
128	002292	奥飞动漫	2,200	83,270.00	0.27
129	002146	荣盛发展	6,548	81,850.00	0.26
130	001696	宗申动力	4,691	80,919.75	0.26
131	002577	雷柏科技	1,000	80,600.00	0.26
132	000983	西山煤电	8,500	80,580.00	0.26
133	002073	软控股份	3,460	79,926.00	0.26
134	002266	浙富控股	5,800	79,344.00	0.25
135	300170	汉得信息	3,250	78,942.50	0.25
136	000977	浪潮信息	2,660	78,603.00	0.25
137	300273	和佳股份	2,627	78,258.33	0.25
138	000661	长春高新	598	77,740.00	0.25
139	002219	恒康医疗	1,739	77,315.94	0.25
140	000616	海航投资	7,420	77,019.60	0.25
141	002007	华兰生物	1,734	76,798.86	0.25
142	002701	奥瑞金	2,920	76,007.60	0.24
143	300212	易华录	1,260	75,524.40	0.24
144	000979	中弘股份	12,464	75,282.56	0.24
145	000078	海王生物	3,313	72,886.00	0.23
146	002573	国电清新	3,500	72,345.00	0.23
147	000511	烯碳新材	5,900	72,275.00	0.23

148	000718	苏宁环球	4,986	71,947.98	0.23
149	300251	光线传媒	2,870	71,463.00	0.23
150	002368	太极股份	1,350	71,185.50	0.23
151	000729	燕京啤酒	6,800	70,720.00	0.23
152	002422	科伦药业	1,734	69,429.36	0.22
153	000006	深振业 A	5,102	69,234.14	0.22
154	000933	神火股份	7,298	68,747.16	0.22
155	300077	国民技术	1,610	68,489.40	0.22
156	300072	三聚环保	2,020	68,074.00	0.22
157	002340	格林美	4,419	67,212.99	0.21
158	300315	掌趣科技	4,950	67,072.50	0.21
159	000758	中色股份	3,410	66,938.30	0.21
160	002063	远光软件	2,140	66,917.80	0.21
161	300133	华策影视	2,450	66,150.00	0.21
162	002161	远望谷	3,000	65,280.00	0.21
163	000999	华润三九	2,148	65,277.72	0.21
164	000516	国际医学	3,000	64,770.00	0.21
165	300228	富瑞特装	811	64,685.36	0.21
166	002250	联化科技	2,881	64,534.40	0.21
167	300274	阳光电源	2,100	64,197.00	0.21
168	000988	华工科技	3,600	64,116.00	0.20
169	300146	汤臣倍健	1,618	63,555.04	0.20
170	002570	贝因美	3,269	63,451.29	0.20
171	000898	鞍钢股份	8,500	62,050.00	0.20
172	002396	星网锐捷	1,900	60,990.00	0.19
173	300202	聚龙股份	1,500	60,600.00	0.19
174	002005	德豪润达	5,232	60,063.36	0.19
175	002344	海宁皮城	3,023	59,341.49	0.19
176	000652	泰达股份	5,825	59,298.50	0.19
177	002051	中工国际	1,982	59,023.96	0.19
178	000816	江淮动力	5,673	58,658.82	0.19
179	002470	金正大	2,700	58,617.00	0.19
180	002261	拓维信息	1,200	58,284.00	0.19
181	000939	凯迪电力	3,976	58,248.40	0.19
182	002190	成飞集成	1,140	58,128.60	0.19
183	000829	天音控股	3,870	57,469.50	0.18
184	002440	闰土股份	2,391	57,312.27	0.18
185	002092	中泰化学	5,611	57,176.09	0.18
186	000062	深圳华强	1,000	57,070.00	0.18
187	000028	国药一致	765	57,000.15	0.18
188	002185	华天科技	3,140	56,582.80	0.18
189	300015	爱尔眼科	1,752	56,519.52	0.18
190	002311	海大集团	4,060	55,987.40	0.18
191	000788	北大医药	2,700	55,944.00	0.18

192	000777	中核科技	1,700	55,845.00	0.18
193	000587	金叶珠宝	2,400	55,512.00	0.18
194	300088	长信科技	2,000	55,000.00	0.18
195	002477	雏鹰农牧	2,840	54,528.00	0.17
196	002299	圣农发展	2,680	54,404.00	0.17
197	000697	炼石有色	1,600	54,128.00	0.17
198	002001	新 和 成	3,152	53,867.68	0.17
199	000088	盐 田 港	3,802	53,836.32	0.17
200	002029	七 匹 狼	2,550	53,550.00	0.17
201	300115	长盈精密	1,600	53,296.00	0.17
202	002467	二六三	2,722	52,942.90	0.17
203	000848	承德露露	2,871	52,252.20	0.17
204	002428	云南锗业	2,222	52,239.22	0.17
205	000685	中山公用	1,756	51,679.08	0.17
206	000528	柳 工	4,355	51,476.10	0.16
207	002179	中航光电	1,540	50,820.00	0.16
208	002050	三花股份	4,420	50,785.80	0.16
209	002424	贵州百灵	800	50,048.00	0.16
210	000671	阳 光 城	2,400	49,872.00	0.16
211	000422	湖北宜化	5,374	49,602.02	0.16
212	000572	海马汽车	5,900	49,501.00	0.16
213	000050	深天马 A	2,105	49,404.35	0.16
214	300039	上海凯宝	3,130	48,671.50	0.16
215	002052	同洲电子	3,500	48,615.00	0.16
216	002399	海普瑞	1,424	48,401.76	0.15
217	000877	天山股份	4,100	48,052.00	0.15
218	000762	西藏矿业	2,500	47,500.00	0.15
219	000975	银泰资源	2,746	47,313.58	0.15
220	000969	安泰科技	3,286	47,252.68	0.15
221	002273	水晶光电	1,500	46,875.00	0.15
222	300090	盛运股份	2,100	46,662.00	0.15
223	002474	榕基软件	2,401	46,651.43	0.15
224	300005	探路者	1,700	46,580.00	0.15
225	002603	以岭药业	2,300	46,368.00	0.15
226	000807	云铝股份	5,640	46,360.80	0.15
227	002064	华峰氨纶	5,074	46,021.18	0.15
228	000541	佛山照明	4,007	45,960.29	0.15
229	300157	恒泰艾普	3,100	45,849.00	0.15
230	002048	宁波华翔	2,200	45,738.00	0.15
231	002095	生 意 宝	708	45,234.12	0.14
232	002242	九阳股份	2,324	45,201.80	0.14
233	000851	高鸿股份	2,610	44,918.10	0.14
234	002294	信立泰	1,561	44,644.60	0.14
235	000554	泰山石油	2,400	44,280.00	0.14

236	000961	中南建设	2,200	43,934.00	0.14
237	000937	冀中能源	5,444	43,660.88	0.14
238	002176	江特电机	1,563	43,638.96	0.14
239	002437	誉衡药业	1,500	43,575.00	0.14
240	002168	深圳惠程	2,700	41,904.00	0.13
241	002041	登海种业	2,350	41,571.50	0.13
242	300134	大富科技	1,480	41,366.00	0.13
243	002414	高德红外	1,045	41,131.20	0.13
244	000681	视觉中国	1,000	41,060.00	0.13
245	000735	罗牛山	4,330	40,658.70	0.13
246	002025	航天电器	1,550	40,610.00	0.13
247	300226	上海钢联	501	40,581.00	0.13
248	000513	丽珠集团	598	40,562.34	0.13
249	002556	辉隆股份	2,000	40,020.00	0.13
250	000550	江铃汽车	1,078	39,562.60	0.13
251	002237	恒邦股份	3,300	39,501.00	0.13
252	002028	思源电气	2,141	39,394.40	0.13
253	000401	冀东水泥	2,951	38,805.65	0.12
254	002262	恩华药业	1,170	37,837.80	0.12
255	002011	盾安环境	2,600	37,674.00	0.12
256	000563	陕国投 A	2,677	37,665.39	0.12
257	002429	兆驰股份	2,900	37,410.00	0.12
258	000786	北新建材	2,000	37,160.00	0.12
259	002277	友阿股份	2,086	35,795.76	0.11
260	002151	北斗星通	700	35,595.00	0.11
261	000596	古井贡酒	760	35,476.80	0.11
262	300052	中青宝	1,100	35,090.00	0.11
263	002138	顺络电子	2,300	35,075.00	0.11
264	002056	横店东磁	1,100	34,408.00	0.11
265	000049	德赛电池	718	34,248.60	0.11
266	002317	众生药业	1,200	33,828.00	0.11
267	002167	东方锆业	2,800	33,572.00	0.11
268	002128	露天煤业	2,026	33,388.48	0.11
269	000630	铜陵有色	3,938	33,236.72	0.11
270	002313	日海通讯	1,700	32,572.00	0.10
271	002653	海思科	1,200	32,400.00	0.10
272	000869	张裕 A	655	31,957.45	0.10
273	002431	棕榈园林	1,080	31,341.60	0.10
274	002229	鸿博股份	1,300	31,044.00	0.10
275	002204	大连重工	2,300	30,728.00	0.10
276	002408	齐翔腾达	1,785	30,594.90	0.10
277	002181	粤传媒	2,060	30,282.00	0.10
278	000860	顺鑫农业	1,305	29,897.55	0.10
279	002148	北纬通信	1,300	29,653.00	0.09

280	300014	亿纬锂能	1,100	29,150.00	0.09
281	300257	开山股份	1,200	29,040.00	0.09
282	002681	奋达科技	1,040	28,558.40	0.09
283	000612	焦作万方	2,550	27,846.00	0.09
284	000525	红太阳	1,200	26,844.00	0.09
285	002079	苏州固锴	2,400	26,136.00	0.08
286	002476	宝莫股份	1,840	25,778.40	0.08
287	000156	华数传媒	700	25,046.00	0.08
288	000823	超声电子	1,700	22,882.00	0.07
289	300026	红日药业	975	21,879.00	0.07
290	002106	莱宝高科	1,315	21,592.30	0.07
291	300191	潜能恒信	800	19,920.00	0.06
292	300074	华平股份	1,280	19,699.20	0.06
293	002416	爱施德	909	18,789.03	0.06
294	002203	海亮股份	1,100	13,981.00	0.04
295	000693	华泽钴镍	300	6,171.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000996	中国中期	700.00	20,020.00	0.06

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	2,526,419.11	10.74
2	000002	万科A	2,492,876.00	10.60
3	000001	平安银行	2,007,415.00	8.53
4	000776	广发证券	1,818,160.63	7.73
5	002673	西部证券	1,731,846.00	7.36
6	300059	东方财富	1,549,500.40	6.59
7	000333	美的集团	1,496,254.84	6.36
8	002024	苏宁云商	1,428,097.00	6.07
9	000166	申万宏源	1,233,243.00	5.24
10	000063	中兴通讯	1,096,947.00	4.66
11	002415	海康威视	1,032,374.00	4.39
12	300104	乐视网	971,658.40	4.13

13	000100	TCL 集团	950,077.00	4.04
14	000858	五 粮 液	909,516.44	3.87
15	000625	长安汽车	885,211.00	3.76
16	000725	京东方 A	870,305.00	3.70
17	002450	康得新	864,224.00	3.67
18	000768	中航飞机	770,888.00	3.28
19	002230	科大讯飞	765,374.00	3.25
20	000503	海虹控股	743,261.88	3.16
21	300168	万达信息	735,480.00	3.13
22	300024	机器人	721,182.00	3.07
23	000728	国元证券	690,478.00	2.94
24	000338	潍柴动力	668,746.00	2.84
25	002202	金风科技	659,198.00	2.80
26	300027	华谊兄弟	652,649.00	2.77
27	000157	中联重科	627,223.00	2.67
28	002183	怡 亚 通	593,263.00	2.52
29	300070	碧水源	592,700.92	2.52
30	000970	中科三环	574,157.00	2.44
31	002065	东华软件	573,243.00	2.44
32	000623	吉林敖东	540,074.60	2.30
33	000686	东北证券	536,982.00	2.28
34	000069	华侨城 A	528,898.00	2.25
35	000538	云南白药	528,220.00	2.25
36	000423	东阿阿胶	527,833.81	2.24
37	002465	海格通信	522,329.00	2.22
38	002104	恒宝股份	513,344.03	2.18
39	002241	歌尔声学	500,548.00	2.13
40	000009	中国宝安	497,923.00	2.12
41	000060	中金岭南	486,254.00	2.07
42	000750	国海证券	484,529.00	2.06

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	2,711,494.58	11.53
2	000002	万 科 A	2,665,791.00	11.33
3	002673	西部证券	2,149,179.00	9.14
4	000001	平安银行	2,030,035.00	8.63
5	000776	广发证券	1,850,120.42	7.87

6	300059	东方财富	1,641,711.00	6.98
7	000333	美的集团	1,531,544.50	6.51
8	002024	苏宁云商	1,467,322.00	6.24
9	000166	申万宏源	1,100,921.00	4.68
10	002415	海康威视	1,097,317.00	4.66
11	000063	中兴通讯	1,086,346.00	4.62
12	000858	五 粮 液	996,790.00	4.24
13	000100	TCL 集团	986,499.00	4.19
14	300104	乐视网	982,065.00	4.17
15	000625	长安汽车	915,795.00	3.89
16	000725	京东方 A	909,036.00	3.86
17	300024	机器人	866,742.00	3.68
18	000503	海虹控股	862,781.00	3.67
19	000768	中航飞机	862,220.00	3.67
20	002450	康得新	836,792.20	3.56
21	002230	科大讯飞	756,905.00	3.22
22	300027	华谊兄弟	731,601.00	3.11
23	000338	潍柴动力	727,772.00	3.09
24	000157	中联重科	716,750.00	3.05
25	000728	国元证券	711,456.88	3.02
26	002202	金风科技	690,944.00	2.94
27	300168	万达信息	685,332.00	2.91
28	000970	中科三环	626,310.20	2.66
29	300070	碧水源	620,081.00	2.64
30	000538	云南白药	594,865.00	2.53
31	000069	华侨城 A	590,375.54	2.51
32	002065	东华软件	576,683.00	2.45
33	002465	海格通信	576,301.00	2.45
34	000623	吉林敖东	575,526.00	2.45
35	000423	东阿阿胶	568,980.84	2.42
36	002241	歌尔声学	558,613.00	2.37
37	000060	中金岭南	547,822.00	2.33
38	002152	广电运通	521,290.16	2.22
39	000009	中国宝安	521,189.00	2.22
40	000686	东北证券	519,716.00	2.21
41	002008	大族激光	500,185.00	2.13
42	002304	洋河股份	499,006.13	2.12
43	000559	万向钱潮	496,727.40	2.11
44	000402	金 融 街	487,105.00	2.07
45	300315	掌趣科技	486,019.50	2.07
46	002456	欧菲光	485,079.00	2.06
47	300253	卫宁软件	484,617.00	2.06
48	002142	宁波银行	472,851.00	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	89,792,354.73
卖出股票的收入（成交）总额	93,915,357.49

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,034,951.00	3.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,034,951.00	3.31

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019321	13 国债 21	8,300	834,731.00	2.67
2	019028	10 国债 28	2,000	200,220.00	0.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本报告期本基金未参与贵金属交易。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期本基金未参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期本基金未参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,396.43

2	应收证券清算款	2,391,196.00
3	应收股利	-
4	应收利息	26,907.37
5	应收申购款	145,981.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,598,481.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有转股期可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002183	怡亚通	727,526.80	2.32	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	000996	中国中期	20,020.00	0.06	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有	持有人结构
------	-----	------	-------

	户数(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
诺德 300A	469	24,384.23	851,164.00	7.44%	10,585,041.00	92.56%
诺德 300B	880	12,995.69	219,476.00	1.92%	11,216,729.00	98.08%
诺德 S300	1,230	7,598.75	46,661.41	0.50%	9,299,802.60	99.50%
合计	2,579	12,492.78	1,117,301.41	3.47%	31,101,572.60	96.53%

8.2 期末上市基金前十名持有人

诺德 300A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	北京中水江河科技发展有限公司	532,564.00	4.66%
2	王东军	525,200.00	4.59%
3	陶俊杰	496,481.00	4.34%
4	吴平	489,800.00	4.28%
5	邱见明	363,255.00	3.18%
6	张太昌	320,863.00	2.81%
7	银河资本-光大银行-银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	300,000.00	2.62%
8	黎金明	295,200.00	2.58%
9	曾文英	282,300.00	2.47%
10	潘顺	279,676.00	2.45%

诺德300B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	夏群葵	1,162,478.00	10.16%
2	陈德成	500,000.00	4.37%
3	庞元龙	500,000.00	4.37%
4	廖善榕	200,000.00	1.75%
5	银河资本-光大银行-银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	200,000.00	1.75%

6	徐敏强	158,200.00	1.38%
7	谢田顺	150,091.00	1.31%
8	戴京晞	150,018.00	1.31%
9	黄勇	150,000.00	1.31%
10	黄晖	149,300.00	1.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺德 300A	-	-
	诺德 300B	-	-
	诺德 S300	745,418.97	7.98%
	合计	745,418.97	2.31%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	诺德 300A	-
	诺德 300B	-
	诺德 S300	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	诺德 300A	-
	诺德 300B	-
	诺德 S300	-
	合计	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺德 300A	诺德 300B	诺德 S300
基金合同生效日（2012 年 9 月 10 日）基金份额总额	33,855,603.00	33,855,603.00	429,715,471.33
本报告期期初基金份额总额	6,178,047.00	6,178,047.00	5,655,482.50
本报告期基金总申购份额	-	-	104,654,747.69
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	90,447,450.18
本报告期基金拆分变动份额	5,258,158.00	5,258,158.00	-10,516,316.00
本报告期期末基金份额总额	11,436,205.00	11,436,205.00	9,346,464.01

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)担任本基金 2015 年度的基金审计机构。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)担任过本基金募集的验资机构，提供过相关服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	144,955,792.23	78.91%	131,967.64	78.91%	-
中投证券	2	24,669,710.63	13.43%	22,459.70	13.43%	-
东兴证券	1	5,285,502.70	2.88%	4,811.90	2.88%	-
浙商证券	1	3,511,527.00	1.91%	3,197.04	1.91%	-
东方证券	2	2,758,228.10	1.50%	2,511.07	1.50%	-
国泰君安	2	2,515,340.96	1.37%	2,289.96	1.37%	-

注：根据中国证监会的有关规定，基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家证券公司租用了基金交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人未新租用交易单元、退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	412,425.37	100.00%	29,200,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间诺德 300A 份额停复牌的公告	三大证券报、公司网站	2015-01-06

2	关于诺德深证 300A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	三大证券报、公司网站	2015-01-07
3	关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	三大证券报、公司网站	2015-01-07
4	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	三大证券报、公司网站	2015-01-22
5	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	三大证券报、公司网站	2015-03-21
6	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	三大证券报、公司网站	2015-03-25
7	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要	三大证券报、公司网站	2015-03-26
8	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告	三大证券报、公司网站	2015-03-26
9	诺德基金关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构并相应开通定投业务及参与费率优惠的公告	三大证券报、公司网站	2015-04-03
10	诺德深证 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	三大证券报、公司网站	2015-04-14
11	诺德基金关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	三大证券报、公司网站	2015-04-14
12	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	三大证券报、公司网站	2015-04-21
13	诺德深证 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第二次提示公告	三大证券报、公司网站	2015-04-22
14	诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	三大证券报、公司网站	2015-04-23
15	诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	三大证券报、公司网站	2015-04-23
16	诺德深证 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第三次提示公告	三大证券报、公司网站	2015-05-12
17	关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告	三大证券报、公司网站	2015-05-13
18	关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间停复牌的公告	三大证券报、公司网站	2015-05-14
19	关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	三大证券报、公司网站	2015-05-15
20	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	三大证券报、公司网站	2015-05-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准诺德深证 300 指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德深证 300 指数分级证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、年度报告、招募说明书及其他临时公告。
- 6、诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2015 半年度报告原文。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：<http://www.nuodefund.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人诺德基金管理有限公司，咨询电话 400-888-0009，或发电子邮件，E-mail:service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司

二〇一五年八月二十五日