

诺德 S300 基金 2016 年第四季度报告

公告日期：2017-01-19

流水号：FB03201701180515

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[报告期内本基金运作遵规守信情况说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易制度和控制方法](#)

[本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[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](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[指数投资按行业分类的股票投资组合](#)

[积极投资按行业分类的股票投资组合](#)

[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](#)

[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](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[本基金投资股指期货的投资政策](#)

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
其他资产构成
报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
开放式基金份额变动
基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2017 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

诺德 S300

场内简称

诺德 S300

基金主代码

165707

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2012-09-10

报告期末基金份额总额

15,217,779.41

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，以实现跟踪深证 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 $\times 95\%$ + 金融同业存款利率 $\times 5\%$

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。

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

基金保证人

-

下属 3 级基金的基金简称

诺德 300A

诺德 300B

诺德 S300

下属 3 级基金的场内简称

诺德 300A

诺德 300B

诺德 S300

下属 3 级基金的交易代码

150092

150093

165707

报告期末下属 3 级基金的份额总额

2932640.00

2932640.00

9352499.41

下属 3 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 S300 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。

主要财务指标

单位：人民币元

项目

主基金(元)

A(元)

B(元)

C(元)

本期已实现收益

-123,832.16

-

-

-

本期利润

-697,703.40

-

-

-

加权平均基金份额本期利润

-0.0472

-

-

-

期末基金资产净值

15,269,382.61

-

-

-

期末基金份额净值

1.003

-

-

-

-

-

-

-

注：注：1.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。

2.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。

基金净值表现

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

过去三个月

-4.39%

0.80%

-3.29%

0.80%

-1.10%

0.00%

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 A

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

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 B

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

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 C

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

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

注：注：本基金成立于 2012 年 9 月 10 日，图示时间段为 2012 年 9 月 10 日至 2016 年 12 月 31 日。

本基金建仓期为 2012 年 9 月 10 日至 2013 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。

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 A

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 B

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 C

其他指标

单位：元

序号

其他指标

报告期（2016-10-01 至 2016-12-31）

序号

其他指标

报告期（2016-12-31）

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

胡洋

本基金基金经理和诺德价值优势混合型证券投资基金基金经理

2014-05-29

-

8

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，具有基金从业资格。

注：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。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.003 元，累计净值为 1.777 元。本报告期份额净值增长率为-4.39%，同期业绩比较基准增长率为-3.29%。

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、停牌复牌和三位小数净值四舍五入等原因所带来的跟踪误差。

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。

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，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人以及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

14,544,514.45

92.48

其中：股票

14,544,514.45

92.48

2	
固定收益投资	
419,454.00	
2.67	
其中：债券	
419,454.00	
2.67	
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	
754,416.12	
4.80	
7	
其他资产	
9,115.03	
0.06	
8	
合计	
15,727,499.60	
100.00	
指数投资按行业分类的股票投资组合	
金额单位：元	
序号	
行业类别	
公允价值（元）	
占基金资产净值比例（%）	
A	

农、林、牧、渔业

206,589.14

1.35

B

采矿业

139,195.36

0.91

C

制造业

8,135,887.47

53.28

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

259,995.28

1.70

E

建筑业

244,612.92

1.60

F

批发和零售业

359,962.12

2.36

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

1,689,730.36

11.07

J

金融业

1,343,628.45

8.80

K

房地产业

1,014,262.34

6.64

L

租赁和商务服务业

254,469.45

1.67

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

268,254.39

1.76

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

65,374.80

0.43

R

文化、体育和娱乐业

405,273.09

2.65

S

综合

67,795.84

0.44

合计

14,455,031.01

94.67

积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

43,243.44

0.28

C

制造业

31,900.00

0.21

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

-

-

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

14,340.00

0.09

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

89,483.44

0.59

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：元

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

000002

万科 A

20,300

417,165.00

2.73
2
000651
格力电器
16,260
400,321.20
2.62
3
000333
美的集团
12,745
359,026.65
2.35
4
000001
平安银行
28,920
263,172.00
1.72
5
000725
京东方 A
87,100
249,106.00
1.63
6
000776
广发证券
13,001
219,196.86
1.44
7
000858
五粮液
6,200
213,776.00
1.40
8
002450
康得新
8,797
168,110.67
1.10
9

002415

海康威视

6,806

162,050.86

1.06

10

002024

苏宁云商

13,500

154,575.00

1.01

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：元

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

000511

ST 烯碳

5,000

31,900.00

0.21

2

000975

银泰资源

1,646

25,743.44

0.17

3

000693

ST 华泽

1,400

17,500.00

0.11

4

300052

中青宝

600

14,340.00

0.09

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元
 序号
 债券品种
 公允价值（元）
 占基金资产净值比例（%）

1
 国家债券
 419,454.00
 2.75

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（可交换债）
 -
 -

8
 同业存单
 -
 -

9
 其他
 -
 -

10

合计

419,454.00

2.75

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

序号

债券代码

债券名称

数量（张）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

019539

16 国债 11

4,200

419,454.00

2.75

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

金额单位：元

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金未投资贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
单位：

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

019539

16 国债 11

4,200

419,454.00

2.75

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买卖）

合约市值（元）

公允价值变动（元）

风险说明

公允价值变动总额合计（元）

-

股指期货投资本期收益（元）

-

股指期货投资本期公允价值变动（元）

-

本基金未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益(元)

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：元

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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情况，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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

2,564.21

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

6,550.82

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

9,115.03

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号

债券代码

债券名称

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

1

000693

ST 华泽

17,500.00

0.11

重大事项

期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

诺德 S300

诺德 300A

诺德 300B

诺德 S300

基金合同生效日的基金份额总额

-
-
-
-

报告期期初基金份额总额

-
2,673,484.00
2,673,484.00
9,593,990.20

报告期期间基金总申购份额

-
-
-
1,516,127.74

报告期期间总赎回份额

-
-
-
1,239,306.53

报告期期间基金拆分变动份额

-
259,156.00
259,156.00
-518,312.00

报告期期末基金份额总额

15,217,779.41
2,932,640.00
2,932,640.00
9,352,499.41

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算调整份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目

诺德 S300

诺德 300A

诺德 300B

诺德 S300

报告期期初管理人持有的本基金份额

-
-
-
-

报告期期间买入申购总份额

-

-
-
-

报告期期间卖出赎回总份额

-
-
-
-

报告期期末管理人持有的本基金份额

-
-
-
-

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-
-
-
-

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

-

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1、中国证监会批准本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文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德深证 300 指数分级证券投资基金本季度报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

存放地点

基金管理人和或基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：

<http://www.nuodefund.com>。

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-mailservice@nuodefund.com。