

# 诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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

送出日期：2019 年 8 月 23 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 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 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		
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	5,856,710.34 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
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
下属分级基金场内简称:	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份额总额	1,372,587.00 份	1,372,587.00 份	3,111,536.34 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	诺德深证 300B 份额具有高风险、高预期	诺德深证 300 份额为常规指数基金份额，

	对稳定的特征。	收益的特征。	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	罗丽娟	王永民
	联系电话	021-68985058	010-66594896
	电子邮箱	lijuan.luo@nuodefund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0009	95566
传真		021-68985121	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
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	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		潘福祥	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-468,832.19
本期利润	979,561.75
加权平均基金份额本期利润	0.1501
本期加权平均净值利润率	19.58%
本期基金份额净值增长率	19.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	55,870.59
期末可供分配基金份额利润	0.0095
期末基金资产净值	4,531,421.12
期末基金份额净值	0.774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	19.70%

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。

4、 本基金合同生效日为 2012 年 9 月 10 日。

#### 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	1.84%	1.25%	3.30%	1.29%	-1.46%	-0.04%
过去三个月	-9.15%	1.71%	-6.11%	1.74%	-3.04%	-0.03%
过去六个月	19.77%	1.68%	26.98%	1.71%	-7.21%	-0.03%
过去一年	-7.69%	1.58%	-0.60%	1.64%	-7.09%	-0.06%
过去三年	-19.51%	1.21%	-5.58%	1.24%	-13.93%	-0.03%
自基金合同	19.70%	1.60%	42.13%	1.57%	-22.43%	0.03%

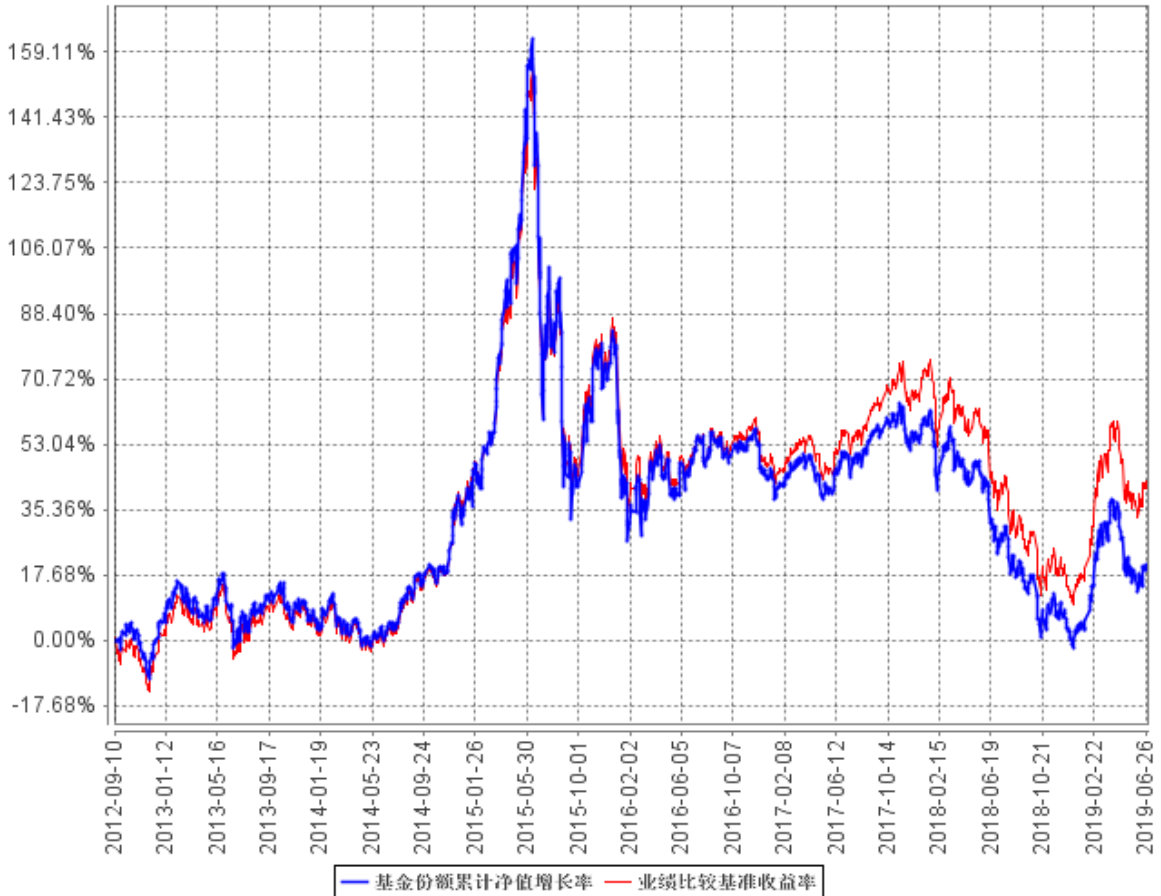


生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2019 年 6 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。公司股东为清华控股有限公司和宜信惠民投资管理（北京）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，公司管理了二十一开放式基金：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、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金以及诺德策略精选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨霞辉	本基金基金经理、诺德优选 30 混合型证券投资基金基金经理	2017 年 4 月 5 日	-	11	同济大学管理学硕士。2007 年 3 月至 2011 年 6 月期间，先后在上海钢联电子商务股份有限公司、中山证券有限责任公司、东北证券股份有限公司担任研究员。2011 年 6 月加入诺德基金管理有限公司，担任研究员，具有基金从业资格。

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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.774 元，累计净值为 1.616 元。本报告期份额净值增长率为 19.77%，同期业绩比较基准增长率为 26.98%。

### 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研究部总监、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验。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；

投资研究部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。

## § 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的真实、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	377,993.50	641,615.27
结算备付金		-	16,328.98
存出保证金		1,029.75	391.94
交易性金融资产	6.4.7.2	4,268,943.95	4,386,584.19
其中：股票投资		4,268,943.95	4,386,584.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	75.20	146.47
应收股利		-	-
应收申购款		596.08	19.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,648,638.48	5,045,086.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		153.03	-
应付管理人报酬		3,632.76	4,265.66
应付托管费		726.58	853.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,118.86	618.67
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,586.13	110,000.00
负债合计		117,217.36	115,737.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,788,516.74	4,936,990.68
未分配利润	6.4.7.10	742,904.38	-7,641.44
所有者权益合计		4,531,421.12	4,929,349.24
负债和所有者权益总计		4,648,638.48	5,045,086.72

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.774 元，基金份额总额 5,856,710.34 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,179,261.03	-969,495.87
1.利息收入		1,810.27	1,922.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,406.38	1,911.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		403.89	10.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-276,116.45	174,543.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-310,365.91	135,628.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	34,249.46	38,914.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,448,393.94	-1,146,745.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,173.27	784.10
<b>减：二、费用</b>		199,699.28	211,666.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,748.21	38,124.39

2. 托管费	6.4.10.2.2	4,949.70	7,624.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,845.81	5,756.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	160,155.56	160,160.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		979,561.75	-1,181,162.67
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		979,561.75	-1,181,162.67

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	4,936,990.68	-7,641.44	4,929,349.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	979,561.75	979,561.75
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）	-1,148,473.94	-229,015.93	-1,377,489.87
其中：1.基金申购款	865,839.20	59,411.41	925,250.61
2.基金赎回款	-2,014,313.14	-288,427.34	-2,302,740.48
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）	3,788,516.74	742,904.38	4,531,421.12
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	5,553,188.51	3,010,160.05	8,563,348.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,181,162.67	-1,181,162.67
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）	-1,152,113.37	-524,897.98	-1,677,011.35
其中：1.基金申购款	95,561.52	45,135.81	140,697.33
2.基金赎回款	-1,247,674.89	-570,033.79	-1,817,708.68
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）	4,401,075.14	1,304,099.40	5,705,174.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          罗凯          </u>	<u>          罗凯          </u>	<u>          高奇          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 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》和《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》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,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(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》和《深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》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”)。投资者可在场外申购和赎回诺德 S300 份额。场外申购的诺德 S300 份额不进行分拆，投资者可将其持有的场外诺德 S300 份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成诺德 300A 份额和诺德 300B 份额后上市交易。诺德 300A 份额与诺德 300B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。基金成立并开放申购赎回后，投资者可在场内申购和赎回诺德 S300 份额，并可选择将其场内申购的每 2 份诺德 S300 份额按 1:1 的比例分拆成诺德 300A 份额和诺德 300B 份额各 1 份。投资者也可按 1:1 的配比将其持有的诺德 300A 份额和诺德 300B 份额申请合并为诺德 S300 份额后赎回。在诺德 300A 份额、诺德 300B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

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。持有场外和场内诺德 S300 份额的基金份额持有人将按前述折算方法获得新增的场外和场内诺德 S300 份额的分配。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大于或者等于 2.000 元，或当诺德 300B 份额的基金份额参考净值小于或者等于 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》和《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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×95%+金融同业存款利率×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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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、会计估计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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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，应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。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，暂免征收个人所得税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	377,993.50
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	377,993.50

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,233,865.46	4,268,943.95	35,078.49
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,233,865.46	4,268,943.95	35,078.49

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	74.70
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.50
合计	75.20

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,118.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,118.86

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.57
其他应付款	80.00
预提费用	59,505.56
指数使用费	50,000.00
合计	109,586.13

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,372,826.50	4,936,990.68
本期申购	1,338,283.28	865,839.20
本期赎回(以“-”号填列)	-3,113,989.22	-2,014,313.14
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	259,589.78	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,856,710.34	3,788,516.74

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。

## 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	572,572.04	-580,213.48	-7,641.44
本期利润	-468,832.19	1,448,393.94	979,561.75
本期基金份额交易产生的变动数	-47,869.26	-181,146.67	-229,015.93
其中：基金申购款	78,055.00	-18,643.59	59,411.41
基金赎回款	-125,924.26	-162,503.08	-288,427.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,870.59	687,033.79	742,904.38

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	1,373.21
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	26.73
其他	6.44
合计	1,406.38

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	3,669,906.15
减：卖出股票成本总额	3,980,272.06
买卖股票差价收入	-310,365.91

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------



股票投资产生的股利收益	34,249.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,249.46

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,448,393.94
——股票投资	1,448,393.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,448,393.94

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	5,173.27
合计	5,173.27

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于7日（含）的投资人收取的赎回费，赎回费总额25%的部分归基金财产所有。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	9,845.81

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	9,845.81

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	-
基金上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	650.00
合计	160,155.56

#### 6.4.7.21 分部报告

不适用。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作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

本基金本报告期内未发生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。

##### 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（“诺德基金”）	基金管理人、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、基金销售机构

清华控股有限公司(“清华控股”)	基金管理人的股东
宜信惠民投资管理(北京)有限公司(“宜信惠民”)	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,748.21	38,124.39
其中：支付销售机构的客户维护费	5,389.96	9,411.69

注：支付基金管理人诺德基金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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,949.70	7,624.86

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。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行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**

本报告期内及上年度可比期间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可比期末，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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	377,993.50	1,373.21	681,307.94	1,895.35

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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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证券投资基金，属于中高风险品种。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、稽核风控部组成。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，因而与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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2018 年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	377,993.50	-	-	-	-	-	377,993.50
存出保证金	1,029.75	-	-	-	-	-	1,029.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,268,943.95	4,268,943.95
应收利息	-	-	-	-	-	75.20	75.20
应收申购款	-	-	-	-	-	596.08	596.08
资产总计	379,023.25	-	-	-	-	4,269,615.23	4,648,638.48
负债							



应付赎回款	-	-	-	-	-	153.03	153.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,632.76	3,632.76
应付托管费	-	-	-	-	-	726.58	726.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,118.86	3,118.86
其他负债	-	-	-	-	-	109,586.13	109,586.13
负债总计	-	-	-	-	-	117,217.36	117,217.36
利率敏感度缺口	379,023.25	-	-	-	-	-4,152,397.87	4,531,421.12
上年度末 2018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	641,615.27	-	-	-	-	-	641,615.27
结算备付金	16,328.98	-	-	-	-	-	16,328.98
存出保证金	391.94	-	-	-	-	-	391.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-4,386,584.19	4,386,584.19
应收利息	-	-	-	-	-	146.47	146.47
应收申购款	-	-	-	-	-	19.87	19.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	658,336.19	-	-	-	-	-4,386,750.53	5,045,086.72
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,265.66	4,265.66
应付托管费	-	-	-	-	-	853.15	853.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	618.67	618.67
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	115,737.48	115,737.48
利率敏感度缺口	658,336.19	-	-	-	-	-4,271,013.05	4,929,349.24

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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

于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券（2018年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018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，本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 300 指数中的基准权重构建股票投资组合。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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比例不低于 85%；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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	4,268,943.95	94.21	4,386,584.19	88.99
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	4,268,943.95	94.21	4,386,584.19	88.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 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：人民币元）
		本期末（2019 年 6 月）      上年度末（2018 年 12 月）

		30 日 )	31 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	219,774.00	240,081.00
	沪深 300 指数下降 5%	-219,774.00	-240,081.00

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 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	4,268,943.95	91.83
	其中：股票	4,268,943.95	91.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	377,993.50	8.13
8	其他各项资产	1,701.03	0.04
9	合计	4,648,638.48	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	138,820.28	3.06
B	采矿业	18,905.00	0.42
C	制造业	2,607,343.69	57.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,757.80	0.97
E	建筑业	21,271.52	0.47
F	批发和零售业	54,821.03	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	43,896.96	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	372,119.16	8.21
J	金融业	323,569.33	7.14
K	房地产业	245,571.26	5.42
L	租赁和商务服务业	81,808.47	1.81
M	科学研究和技术服务业	11,408.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	19,233.01	0.42

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,865.00	0.15
Q	卫生和社会工作	67,038.09	1.48
R	文化、体育和娱乐业	76,532.86	1.69
S	综合	7,674.24	0.17
	合计	4,140,635.70	91.38

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,159.00	0.03
B	采矿业	532.00	0.01
C	制造业	87,079.89	1.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,426.00	0.03
F	批发和零售业	7,749.00	0.17
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	15,092.00	0.33
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	10,395.00	0.23
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	4,875.36	0.11
S	综合	-	-
	合计	128,308.25	2.83

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	000333	美的集团	3,679	190,792.94	4.21
2	000651	格力电器	3,403	187,165.00	4.13
3	000858	五粮液	1,100	129,745.00	2.86
4	000002	万科 A	3,400	94,554.00	2.09
5	000001	平安银行	5,820	80,199.60	1.77
6	300498	温氏股份	2,004	71,863.44	1.59
7	300750	宁德时代	900	61,992.00	1.37
8	000063	中兴通讯	1,900	61,807.00	1.36
9	002415	海康威视	2,109	58,166.22	1.28
10	002714	牧原股份	940	55,262.60	1.22
11	002304	洋河股份	431	52,392.36	1.16
12	000568	泸州老窖	596	48,174.68	1.06
13	002027	分众传媒	8,988	47,546.52	1.05
14	002475	立讯精密	1,842	45,663.18	1.01
15	300059	东方财富	3,114	42,194.70	0.93
16	000725	京东方 A	12,200	41,968.00	0.93
17	001979	招商蛇口	2,000	41,800.00	0.92
18	002230	科大讯飞	1,225	40,719.00	0.90
19	000538	云南白药	475	39,624.50	0.87
20	000661	长春高新	117	39,546.00	0.87
21	300015	爱尔眼科	1,257	38,929.29	0.86
22	000338	潍柴动力	3,120	38,344.80	0.85
23	002142	宁波银行	1,549	37,547.76	0.83
24	002594	比亚迪	700	35,504.00	0.78
25	000166	申万宏源	6,725	33,692.25	0.74
26	300124	汇川技术	1,446	33,127.86	0.73
27	300760	迈瑞医疗	200	32,640.00	0.72
28	300142	沃森生物	1,000	28,360.00	0.63
29	000776	广发证券	2,001	27,493.74	0.61
30	002202	金风科技	2,036	25,307.48	0.56
31	000100	TCL 集团	7,400	24,642.00	0.54
32	002008	大族激光	713	24,512.94	0.54
33	000596	古井贡酒	200	23,702.00	0.52

34	002422	科伦药业	768	22,832.64	0.50
35	000157	中联重科	3,685	22,146.85	0.49
36	300014	亿纬锂能	697	21,230.62	0.47
37	300017	网宿科技	1,958	21,107.24	0.47
38	300024	机器人	1,381	21,032.63	0.46
39	300003	乐普医疗	910	20,948.20	0.46
40	300144	宋城演艺	885	20,478.90	0.45
41	000876	新希望	1,160	20,149.20	0.44
42	000895	双汇发展	800	19,912.00	0.44
43	002007	华兰生物	651	19,848.99	0.44
44	002821	凯莱英	200	19,616.00	0.43
45	300136	信维通信	800	19,560.00	0.43
46	002236	大华股份	1,347	19,558.44	0.43
47	000413	东旭光电	3,800	19,532.00	0.43
48	000425	徐工机械	4,316	19,249.36	0.42
49	002001	新和成	978	18,865.62	0.42
50	300383	光环新网	1,100	18,447.00	0.41
51	002410	广联达	550	18,089.50	0.40
52	002311	海大集团	560	17,304.00	0.38
53	002405	四维图新	1,065	17,146.50	0.38
54	002352	顺丰控股	500	16,980.00	0.37
55	002157	正邦科技	1,000	16,660.00	0.37
56	002271	东方雨虹	720	16,315.20	0.36
57	002926	华西证券	1,500	15,750.00	0.35
58	300601	康泰生物	300	15,750.00	0.35
59	002127	南极电商	1,400	15,736.00	0.35
60	000977	浪潮信息	658	15,699.88	0.35
61	002739	万达电影	850	15,674.00	0.35
62	000783	长江证券	2,000	15,620.00	0.34
63	000768	中航飞机	987	15,545.25	0.34
64	000423	东阿阿胶	389	15,489.98	0.34
65	300347	泰格医药	200	15,420.00	0.34
66	002507	涪陵榨菜	500	15,250.00	0.34
67	002466	天齐锂业	600	15,168.00	0.33
68	002032	苏泊尔	200	15,166.00	0.33
69	300207	欣旺达	1,300	14,976.00	0.33
70	002024	苏宁易购	1,300	14,924.00	0.33
71	002555	三七互娱	1,100	14,905.00	0.33
72	000963	华东医药	573	14,875.08	0.33

73	000540	中天金融	3,825	14,649.75	0.32
74	000630	铜陵有色	5,945	14,624.70	0.32
75	300253	卫宁健康	1,028	14,577.04	0.32
76	300001	特锐德	800	14,416.00	0.32
77	300146	汤臣倍健	736	14,278.40	0.32
78	300296	利亚德	1,800	14,094.00	0.31
79	002460	赣锋锂业	600	14,058.00	0.31
80	000728	国元证券	1,518	13,920.06	0.31
81	002371	北方华创	200	13,850.00	0.31
82	002129	中环股份	1,400	13,664.00	0.30
83	000703	恒逸石化	1,000	13,660.00	0.30
84	300408	三环集团	700	13,615.00	0.30
85	002153	石基信息	376	13,607.44	0.30
86	002439	启明星辰	500	13,450.00	0.30
87	300450	先导智能	399	13,406.40	0.30
88	300009	安科生物	800	12,720.00	0.28
89	000786	北新建材	700	12,691.00	0.28
90	002044	美年健康	1,020	12,688.80	0.28
91	000961	中南建设	1,450	12,557.00	0.28
92	000563	陕国投 A	2,800	12,432.00	0.27
93	002465	海格通信	1,300	12,402.00	0.27
94	300413	芒果超媒	300	12,315.00	0.27
95	002463	沪电股份	900	12,258.00	0.27
96	000750	国海证券	2,414	12,142.42	0.27
97	000623	吉林敖东	736	12,063.04	0.27
98	000709	河钢股份	4,000	11,960.00	0.26
99	000066	中国长城	1,156	11,883.68	0.26
100	002456	欧菲光	1,505	11,799.20	0.26
101	002179	中航光电	349	11,677.54	0.26
102	000671	阳光城	1,800	11,664.00	0.26
103	002081	金螳螂	1,110	11,444.10	0.25
104	300676	华大基因	200	11,408.00	0.25
105	002223	鱼跃医疗	460	11,325.20	0.25
106	002013	中航机电	1,600	11,008.00	0.24
107	000690	宝新能源	1,700	10,948.00	0.24
108	000625	长安汽车	1,640	10,873.20	0.24
109	002493	荣盛石化	900	10,854.00	0.24
110	002065	东华软件	1,548	10,820.52	0.24
111	300072	三聚环保	1,336	10,594.48	0.23



112	002050	三花智控	1,000	10,550.00	0.23
113	002500	山西证券	1,300	10,530.00	0.23
114	000686	东北证券	1,194	10,519.14	0.23
115	002252	上海莱士	1,491	10,362.45	0.23
116	002624	完美世界	400	10,324.00	0.23
117	000031	大悦城	1,600	10,272.00	0.23
118	002797	第一创业	1,620	10,270.80	0.23
119	002268	卫士通	420	10,269.00	0.23
120	000069	华侨城 A	1,471	10,223.45	0.23
121	002384	东山精密	700	10,199.00	0.23
122	002120	韵达股份	328	10,108.96	0.22
123	000997	新大陆	598	10,100.22	0.22
124	300166	东方国信	820	10,077.80	0.22
125	000513	丽珠集团	300	9,969.00	0.22
126	000503	国新健康	576	9,884.16	0.22
127	002146	荣盛发展	1,048	9,840.72	0.22
128	300033	同花顺	100	9,836.00	0.22
129	000629	攀钢钒钛	2,900	9,831.00	0.22
130	002092	中泰化学	1,211	9,639.56	0.21
131	000988	华工科技	600	9,492.00	0.21
132	000050	深天马 A	705	9,475.20	0.21
133	002195	二三四五	2,380	9,258.20	0.20
134	002736	国信证券	700	9,212.00	0.20
135	300073	当升科技	400	9,188.00	0.20
136	300699	光威复材	280	9,156.00	0.20
137	000960	锡业股份	818	9,137.06	0.20
138	002368	太极股份	300	9,090.00	0.20
139	300070	碧水源	1,156	9,005.24	0.20
140	002508	老板电器	330	8,956.20	0.20
141	300188	美亚柏科	500	8,915.00	0.20
142	300316	晶盛机电	700	8,883.00	0.20
143	000401	冀东水泥	500	8,805.00	0.19
144	002138	顺络电子	500	8,790.00	0.19
145	300496	中科创达	300	8,724.00	0.19
146	000830	鲁西化工	800	8,704.00	0.19
147	002075	沙钢股份	1,100	8,624.00	0.19
148	300122	智飞生物	200	8,620.00	0.19
149	002602	世纪华通	788	8,604.96	0.19
150	002773	康弘药业	260	8,559.20	0.19

151	002373	千方科技	500	8,550.00	0.19
152	002831	裕同科技	440	8,434.80	0.19
153	300274	阳光电源	900	8,415.00	0.19
154	000039	中集集团	787	8,405.16	0.19
155	002399	海普瑞	400	8,396.00	0.19
156	000723	美锦能源	800	8,360.00	0.18
157	002340	格林美	1,769	8,331.99	0.18
158	300558	贝达药业	200	8,300.00	0.18
159	000656	金科股份	1,344	8,104.32	0.18
160	300027	华谊兄弟	1,637	8,037.67	0.18
161	002506	协鑫集成	1,200	8,016.00	0.18
162	000060	中金岭南	1,706	8,001.14	0.18
163	002281	光迅科技	300	7,944.00	0.18
164	000975	银泰资源	600	7,914.00	0.17
165	002074	国轩高科	600	7,866.00	0.17
166	300251	光线传媒	1,140	7,752.00	0.17
167	300418	昆仑万维	600	7,722.00	0.17
168	000581	威孚高科	414	7,683.84	0.17
169	000009	中国宝安	1,344	7,674.24	0.17
170	000547	航天发展	800	7,648.00	0.17
171	002353	杰瑞股份	330	7,623.00	0.17
172	002385	大北农	1,434	7,585.86	0.17
173	002670	国盛金控	600	7,560.00	0.17
174	000878	云南铜业	707	7,515.41	0.17
175	002078	太阳纸业	1,100	7,491.00	0.17
176	002110	三钢闽光	800	7,440.00	0.16
177	002019	亿帆医药	600	7,350.00	0.16
178	000825	太钢不锈	1,800	7,326.00	0.16
179	000999	华润三九	248	7,276.32	0.16
180	002558	巨人网络	400	7,268.00	0.16
181	000046	泛海控股	1,293	7,214.94	0.16
182	002294	信立泰	321	7,183.98	0.16
183	000402	金融街	912	7,150.08	0.16
184	000627	天茂集团	1,100	7,139.00	0.16
185	002600	领益智造	1,200	7,116.00	0.16
186	002299	圣农发展	280	7,089.60	0.16
187	300088	长信科技	1,400	7,084.00	0.16
188	002185	华天科技	1,384	7,044.56	0.16
189	002372	伟星新材	400	6,960.00	0.15

190	000028	国药一致	165	6,901.95	0.15
191	000898	鞍钢股份	1,820	6,897.80	0.15
192	002607	中公教育	500	6,865.00	0.15
193	002180	纳思达	300	6,780.00	0.15
194	002038	双鹭药业	287	6,761.72	0.15
195	300058	蓝色光标	1,565	6,682.55	0.15
196	000932	华菱钢铁	1,400	6,678.00	0.15
197	000983	西山煤电	1,100	6,666.00	0.15
198	000826	启迪桑德	563	6,637.77	0.15
199	000732	泰禾集团	400	6,600.00	0.15
200	002085	万丰奥威	900	6,552.00	0.14
201	002690	美亚光电	200	6,520.00	0.14
202	000883	湖北能源	1,500	6,510.00	0.14
203	000778	新兴铸管	1,444	6,411.36	0.14
204	300133	华策影视	940	6,326.20	0.14
205	000089	深圳机场	700	6,223.00	0.14
206	002673	西部证券	607	6,118.56	0.14
207	000807	云铝股份	1,300	6,097.00	0.13
208	000559	万向钱潮	1,016	6,075.68	0.13
209	002589	瑞康医药	800	6,072.00	0.13
210	002010	传化智联	800	6,024.00	0.13
211	300182	捷成股份	1,349	5,949.09	0.13
212	000027	深圳能源	959	5,945.80	0.13
213	002601	龙蟠佰利	400	5,932.00	0.13
214	002241	歌尔股份	662	5,885.18	0.13
215	002583	海能达	700	5,873.00	0.13
216	002938	鹏鼎控股	200	5,872.00	0.13
217	002152	广电运通	854	5,849.90	0.13
218	002183	怡亚通	1,220	5,819.40	0.13
219	000887	中鼎股份	600	5,754.00	0.13
220	000488	晨鸣纸业	1,050	5,628.00	0.12
221	000860	顺鑫农业	120	5,598.00	0.12
222	000539	粤电力 A	1,300	5,590.00	0.12
223	002212	南洋股份	400	5,480.00	0.12
224	300170	汉得信息	400	5,436.00	0.12
225	002408	齐翔腾达	700	5,425.00	0.12
226	002310	东方园林	900	5,400.00	0.12
227	000738	航发控制	400	5,360.00	0.12
228	000528	柳工	800	5,328.00	0.12

229	000040	东旭蓝天	800	5,312.00	0.12
230	000839	中信国安	1,317	5,294.34	0.12
231	000008	神州高铁	1,400	5,278.00	0.12
232	000930	中粮生化	700	5,264.00	0.12
233	000598	兴蓉环境	1,140	5,187.00	0.11
234	002640	跨境通	600	4,998.00	0.11
235	002468	申通快递	200	4,988.00	0.11
236	002217	合力泰	900	4,977.00	0.11
237	002176	江特电机	1,000	4,870.00	0.11
238	002491	通鼎互联	600	4,854.00	0.11
239	300113	顺网科技	300	4,704.00	0.10
240	002745	木林森	400	4,688.00	0.10
241	000729	燕京啤酒	700	4,648.00	0.10
242	002151	北斗星通	200	4,646.00	0.10
243	000998	隆平高科	318	4,604.64	0.10
244	002244	滨江集团	1,100	4,565.00	0.10
245	002056	横店东磁	600	4,560.00	0.10
246	300459	金科文化	800	4,552.00	0.10
247	002839	张家港行	800	4,504.00	0.10
248	000059	华锦股份	700	4,480.00	0.10
249	002302	西部建设	400	4,456.00	0.10
250	002051	中工国际	386	4,427.42	0.10
251	002563	森马服饰	400	4,424.00	0.10
252	002426	胜利精密	1,700	4,352.00	0.10
253	002128	露天煤业	500	4,325.00	0.10
254	002262	恩华药业	400	4,316.00	0.10
255	002608	江苏国信	500	4,265.00	0.09
256	300433	蓝思科技	610	4,251.70	0.09
257	002358	森源电气	400	4,060.00	0.09
258	000717	韶钢松山	900	3,987.00	0.09
259	300315	掌趣科技	1,150	3,967.50	0.09
260	002419	天虹股份	300	3,918.00	0.09
261	300168	万达信息	300	3,891.00	0.09
262	000301	东方盛虹	700	3,843.00	0.08
263	300038	数知科技	400	3,744.00	0.08
264	002366	台海核电	400	3,744.00	0.08
265	002572	索菲亚	200	3,712.00	0.08
266	002285	世联行	800	3,608.00	0.08
267	300197	铁汉生态	1,000	3,590.00	0.08

268	002939	长城证券	200	3,338.00	0.07
269	001965	招商公路	400	3,332.00	0.07
270	000553	安道麦 A	300	3,216.00	0.07
271	000564	供销大集	1,200	3,132.00	0.07
272	002424	贵州百灵	300	2,964.00	0.07
273	000537	广宇发展	400	2,768.00	0.06
274	002382	蓝帆医疗	200	2,764.00	0.06
275	300222	科大智能	200	2,604.00	0.06
276	002936	郑州银行	500	2,540.00	0.06
277	000429	粤高速 A	300	2,265.00	0.05
278	000959	首钢股份	600	2,112.00	0.05
279	002625	光启技术	200	1,858.00	0.04
280	000987	越秀金控	200	1,804.00	0.04
281	000617	中油资本	100	1,236.00	0.03

### 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	002168	惠程科技	1,000	8,850.00	0.20
2	002450	*ST 康得	2,697	8,711.31	0.19
3	000970	中科三环	710	8,058.50	0.18
4	002221	东华能源	900	7,749.00	0.17
5	002273	水晶光电	545	6,311.10	0.14
6	002407	多氟多	500	5,920.00	0.13
7	300036	超图软件	400	5,912.00	0.13
8	000877	天山股份	500	5,810.00	0.13
9	002597	金禾实业	300	5,472.00	0.12
10	002470	金正大	1,500	5,460.00	0.12
11	002030	达安基因	486	5,214.78	0.12
12	002497	雅化集团	700	4,893.00	0.11
13	000793	华闻传媒	1,451	4,875.36	0.11
14	002709	天赐材料	200	4,840.00	0.11
15	002665	首航节能	1,280	4,339.20	0.10
16	002280	联络互动	1,150	4,209.00	0.09
17	300355	蒙草生态	1,000	4,100.00	0.09
18	002635	安洁科技	300	4,047.00	0.09
19	002573	清新环境	500	4,025.00	0.09

20	000933	神火股份	900	3,789.00	0.08
21	002411	延安必康	200	3,480.00	0.08
22	300377	赢时胜	300	3,396.00	0.07
23	300266	兴源环境	500	2,270.00	0.05
24	002359	*ST 北讯	500	1,575.00	0.03
25	300159	新研股份	300	1,494.00	0.03
26	300055	万邦达	200	1,426.00	0.03
27	002477	*ST 雏鹰	1,220	1,159.00	0.03
28	000693	华泽退	1,400	532.00	0.01
29	002716	金贵银业	50	390.00	0.01

## 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	000858	五粮液	170,125.00	3.45
2	000333	美的集团	143,386.20	2.91
3	000651	格力电器	125,720.00	2.55
4	300498	温氏股份	71,511.00	1.45
5	300750	宁德时代	66,372.00	1.35
6	002714	牧原股份	56,081.00	1.14
7	000002	万科 A	49,353.00	1.00
8	000725	京东方 A	47,919.00	0.97
9	000001	平安银行	37,666.00	0.76
10	300124	汇川技术	32,554.00	0.66
11	002415	海康威视	32,120.00	0.65
12	002027	分众传媒	30,500.00	0.62
13	002024	苏宁易购	28,263.00	0.57
14	000063	中兴通讯	27,547.00	0.56
15	002044	美年健康	26,002.00	0.53
16	300015	爱尔眼科	23,116.00	0.47
17	002384	东山精密	22,504.00	0.46
18	000425	徐工机械	22,032.00	0.45
19	300059	东方财富	21,493.00	0.44
20	002736	国信证券	20,806.00	0.42

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	000858	五粮液	219,478.00	4.45
2	000333	美的集团	217,488.48	4.41
3	000651	格力电器	205,427.03	4.17
4	300498	温氏股份	146,776.00	2.98
5	000725	京东方 A	106,282.00	2.16
6	002415	海康威视	89,273.00	1.81
7	000002	万科 A	84,589.00	1.72
8	000001	平安银行	81,480.00	1.65
9	002024	苏宁易购	59,857.00	1.21
10	300059	东方财富	49,656.00	1.01
11	000063	中兴通讯	45,863.00	0.93
12	000776	广发证券	45,070.00	0.91
13	002736	国信证券	40,457.00	0.82
14	002044	美年健康	38,392.00	0.78
15	000338	潍柴动力	35,827.00	0.73
16	002714	牧原股份	35,403.00	0.72
17	002304	洋河股份	33,954.00	0.69
18	002142	宁波银行	33,431.00	0.68
19	002027	分众传媒	32,634.00	0.66
20	000783	长江证券	31,948.00	0.65

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

买入股票成本（成交）总额	2,414,237.88
卖出股票收入（成交）总额	3,669,906.15

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，平安银行（000001）的发行主体平安银行股份有限公司（以下简称“公司”）在过去一年内存在被监管处罚的情形。

（1）因公司贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款



被挪用原因，依据《中国银监会关于印发〈节能减排授信工作指导意见〉的通知》（银监发〔2007〕83号）第五条，《中国银监会关于印发绿色信贷指引的通知》（银监发〔2012〕4号）第十七条，《流动资金贷款管理暂行办法》第九条、第十三条、第三十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，天津银监局于2018年6月28日对公司作出了罚款人民币50万元的行政处罚。

(2) 因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。2018年7月26日中国人民银行根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以50万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，中国人民银行根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以40万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，中国人民银行根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以50万元罚款；对平安银行合计处以140万元罚款。

对平安银行的投资决策程序的说明：

本基金管理人长期跟踪研究该股票，我们认为，该项处罚的处罚力度对上市公司长期经营和投资价值影响不大，我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	1,029.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75.20
5	应收申购款	596.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,701.03

#### **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处于转股期的可转换债券。

#### **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**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

##### **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**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限股票。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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	93	14,759.00	24,700.00	1.80%	1,347,887.00	98.20%
诺德 300B	235	5,840.80	-	-	1,372,587.00	100.00%
诺德 S300	853	3,647.76	653.00	0.02%	3,110,883.34	99.98%
合计	1,181	4,959.11	25,353.00	0.43%	5,831,357.34	99.57%

### 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	余志胜	526,305.00	38.34%
2	郭琴	165,000.00	12.02%
3	黄鸿	149,958.00	10.93%
4	杨凯	125,000.00	9.11%
5	王丹茹	73,453.00	5.35%
6	陈能江	53,133.00	3.87%
7	李君	46,200.00	3.37%
8	殷洁	31,500.00	2.29%
9	魏国强	30,000.00	2.19%
10	曹凤路	22,463.00	1.64%

诺德 300B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	谢燕珍	148,289.00	10.80%
2	甘遵义	81,000.00	5.90%
3	肖焕文	75,800.00	5.52%
4	王雷	73,834.00	5.38%
5	黄超媚	59,000.00	4.30%
6	沈卫萍	48,200.00	3.51%
7	吉凯	45,028.00	3.28%
8	杨丽	40,825.00	2.97%
9	冯景阳	39,600.00	2.89%
10	孔明	38,948.00	2.84%

**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	0.00	0.00%
	诺德 300B	0.00	0.00%
	诺德 S300	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

**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	0
	诺德 300B	0
	诺德 S300	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺德 300A	0
	诺德 300B	0
	诺德 S300	0
	合计	0

## § 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	2,096,874.00	2,096,874.00	3,179,078.50
本报告期基金总申购份额	-	-	1,597,894.70
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	3,114,010.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-724,287.00	-724,287.00	1,448,574.00
本报告期期末基金份额总额	1,372,587.00	1,372,587.00	3,111,536.34

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。

## § 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

(1) 本基金管理人 2019 年 5 月 25 日发布公告，严亚锋先生自 2019 年 5 月 24 日起担任公司首席信息官。本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

(2) 本基金托管人：2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 2019 年度的基金审计机构。目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供过 7 年的审计服务。

### 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	

东方证券	1	6,063,234.45	100.00%	5,646.87	100.00%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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新租交易单元：无，退租交易单元：无。

## 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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

东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	800,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 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	诺德基金管理有限公司旗下基金资产净值与份额净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月2日
2	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月3日
3	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月4日
4	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月4日
5	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月5日
6	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月8日
7	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019年1月9日
8	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风	上海证券报、中国证券报、证券时报、公	2019年1月12日



	险提示公告	司官网	
9	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风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司官网	2019 年 1 月 17 日
10	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报、公司官网	2019 年 1 月 21 日
11	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风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 1 月 23 日
12	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风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 1 月 29 日
13	诺德基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 1 月 30 日
14	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风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 2 月 2 日
15	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 2 月 2 日
16	诺德基金管理有限公司关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金暂停大额申购业务的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 2 月 28 日
17	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额交易价格波动 提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 3 月 1 日
18	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	上海证券报、公司官网	2019 年 3 月 5 日
19	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告	上海证券报、公司官网	2019 年 3 月 27 日
20	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要	上海证券报、公司官网	2019 年 3 月 27 日
21	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 3 月 28 日
22	诺德基金管理有限公司关于新增重庆银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务和转换业务的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 11 日
23	诺德基金管理有限公司关于新增联储证券有限责任公司为旗下部	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 15 日

	分基金代销机构并相应开通定投业务与转换业务及参与费率优惠的公告		
24	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 19 日
25	诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 23 日
26	诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 23 日
27	诺德基金管理有限公司关于新增万联证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并相应开通定投业务的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 24 日
28	诺德基金管理有限公司关于暂停网上交易平台“银联通”支付渠道申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 4 月 27 日
29	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 6 日
30	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 7 日
31	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 10 日
32	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 15 日
33	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 18 日
34	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 23 日
35	诺德基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 25 日
36	“诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 28 日
37	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 5 月 31 日
38	“诺德深证 300 指数分级证券投	上海证券报、公司官	2019 年 6 月 5 日

	资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	网	
39	“诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 6 月 11 日
40	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 6 月 19 日
41	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 6 月 22 日
42	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持“中科曙光”股票估值调整的公告	上海证券报、公司官网	2019 年 6 月 25 日
43	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300 B 份额风险提示公告	上海证券报、公司官网	2019 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 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 2019 年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所，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、(021)68604888，或发电子邮件，E-mail:service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日