
诺德深证 300 指数分级证券投资基金 基金合同

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

二〇一九年 十二月

目 录

一、前言.....	2
二、释义.....	3
三、基金的基本情况.....	9
四、基金份额的分类与净值计算规则.....	11
五、基金份额的发售与认购.....	14
六、基金的备案.....	17
七、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的上市交易	18
八、诺德深证 300 份额的申购、赎回与转换	19
九、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管	27
十、基金的非交易过户、转托管、定期定额投资计划、冻结与质押	28
十一、基金的份额配对转换.....	29
十二、基金合同当事人及其权利义务	31
十三、基金份额持有人大会	38
十四、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	44
十五、基金的托管	47
十六、基金的销售.....	47
十七、基金份额的注册登记.....	47
十八、基金的投资.....	48
十九、基金的融资、融券.....	54
二十、基金的财产.....	54
二十一、基金资产的估值.....	55
二十二、基金费用与税收.....	58
二十三、基金收益与分配.....	60
二十四、基金份额折算.....	60
二十五、基金的会计与审计.....	68
二十六、基金的信息披露.....	69
二十七 基金的业务规则	75
二十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	75
二十九、违约责任.....	78
三十、争议的处理.....	78
三十一、基金合同的效力	79

一、前言

(一) 订立《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范诺德深证 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)的运作,保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)及其他法律法规的有关规定。

3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二) 本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三) 本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

(四) 本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》

实施之日起一年后开始执行。

二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指诺德深证 300 指数分级证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新；
基金产品资料概要：	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
发售公告：	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
上市交易公告书	指《诺德深证 300 指数分级证券投资基金之深证 300A 份额与深证 300B 份额上市交易公告书》；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布并于 2019 年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作

	出的修订；
《流动性风险规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指诺德基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指诺德基金管理有限公司或接受诺德基金管理有限公司委托的其他符合条件的办理基金注册登记的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；

基金合同生效日:	指募集结束, 基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的, 基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后, 中国证监会的书面确认之日;
存续期:	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限;
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
认购:	指在基金募集期内, 投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为;
申购:	指在本基金合同生效后的存续期间, 投资者申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指在本基金合同生效后的存续期间, 基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为;
基金转换:	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件, 申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为;
转托管:	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为, 包括跨系统转托管和系统内转托管;
指令:	指基金管理人在运用基金财产进行投资时, 向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件, 取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托, 代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构, 以及具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位;
销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;

基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点;
指定媒介:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”,包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介;
基金账户:	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户;
交易账户:	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户;
开放日:	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日;
折算基准日	<p>基金份额定期折算:折算基准日为每个会计年度的第一个工作日(除基金合同生效日所在会计年度外)</p> <p>基金份额不定期折算:当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元或诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元,基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。</p>
T 日:	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日。
T+n 日:	指 T 日后(不包括 T 日)第 n 个工作日, n 指自然数;
基金收益:	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他已实现的合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约;
基金资产总值:	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
基金资产估值:	指计算、评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺

	德深证 300B 份额参考净值的过程；
流动性受限资产：	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等；
流通受限证券	包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券；
诺德深证 300 份额	本基金的基础份额。投资者在场外认/申购的诺德深证 300 份额不进行基金份额分拆；投资者在场内认购的诺德深证 300 份额将自动进行基金份额分离；投资者在场内申购的诺德深证 300 份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆；
诺德深证 300A 份额	本基金基础份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额；
诺德深证 300B 份额	本基金基础份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额；
诺德深证 300A 份额的本金	除非基金合同文义另有所指，对于诺德深证 300A 份额而言，

	指人民币 1.000 元；
场外	通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回；
场内	通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；
注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统；
证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统；
上市交易	基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的行为；
系统内转托管	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转托管	基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为；
自动分离	指投资者在场内认购的每两份诺德深证 300 份额在发售结束后按 1:1 比例自动转换为一份诺德深证 300A 份额和一份诺德深证 300B 份额的行为；
配对转换	指本基金的诺德深证 300 份额与诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并；
分拆	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每两份诺德深证 300 份额的场内份额申请转换成一份诺德深证 300A 份额与一份诺德深证 300B 进份额的行为；

合并	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每一份诺德深证 300A 份额与一份诺德深证 300B 份额申请转换成两份诺德深证 300 份额的场内份额的行为；
诺德深证 300A 份额约定年基准收益率	本基金为每份诺德深证 300A 份额所设定的每年应获得的收益率，诺德深证 300A 份额约定年基准收益率为 1 年期同期银行定期存款利率(税后)+3%，1 年期同期银行定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3%”。；
诺德深证 300A 份额约定年应得收益	诺德深证 300A 份额在每个会计年度应获得的约定基准收益。但基金管理人并不承诺或保证诺德深证 300A 份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，诺德深证 300A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险；
诺德深证 300A 份额约定日应得收益	依据诺德深证 300A 份额约定年基准收益率计算的每日收益；
诺德深证 300B 份额应得资产及收益	在每个会计年度期末，本基金净资产优先分配予诺德深证 300A 份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产；虽然本基金设定了不定期折算条款，以避免诺德深证 300B 份额因市场波动过大所面临的风险，但在某些极端损失情况下，诺德深证 300B 份额的基金份额持有人可能面临投资本金大幅亏损甚至为零的风险。
标的指数	深证 300 价格指数。

三、基金的基本情况

（一）基金名称

诺德深证 300 指数分级证券投资基金

（二）基金的类别

股票型证券投资基金

（三）基金的运作方式

契约型开放式

（四）基金投资目标

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。

（五）基金份额自动分离与分拆

基金发售结束后,投资者场内认购的全部诺德深证 300 份额将按 1: 1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别,即稳健收益类的诺德深证 300A 份额和积极收益类的诺德深证 300B 份额,两类基金份额的基金资产合并运作。

投资者可在场内申购诺德深证 300 份额,并可选择将其申购的诺德深证 300 份额按 1: 1 的比例分拆为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。

投资者在场外认购和申购的诺德深证 300 份额不进行分拆,其通过跨系统转托管至场内后,可选择将其持有的诺德深证 300 份额按 1: 1 的比例分拆为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。

（六）基金份额的上市交易

本基金基金合同生效后,场内的诺德深证 300A 和诺德深证 300B 份额将按照有关规定同时申请在深圳证券交易所上市交易。

（七）基金份额初始发售面值

诺德深证 300 份额的初始发售面值为人民币 1.000 元。

（八）基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币。

（九）基金存续期限

不定期

四、基金份额的分类与净值计算规则

（一）基金份额结构

本基金为指数分级型证券投资基金，其基金份额包括三类，分别为诺德深证 300 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“诺德深证 300 份额”）、诺德深证 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“诺德深证 300A 份额”）与诺德深证 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“诺德深证 300B 份额”）。其中，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比率不变。

（二）基金份额的自动分离与分拆规则

基金发售结束后，本基金将投资者在场内认购的全部诺德深证 300 份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。

根据诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的基金份额比例，诺德深证 300A 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，诺德深证 300B 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，且两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，诺德深证 300 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额交易代码不同，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。

投资者可在场内申购和赎回诺德深证 300 份额，投资者可选择将其场内申购的诺德深证 300 份额按 1:1 的比例分拆成诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额申请合并为诺德深证 300 后赎回。

投资者可在场外申购和赎回诺德深证 300 份额。场外申购的诺德深证 300 份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外诺德深证 300 份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额合并为诺德深证 300 份额后赎回。

无论是定期份额折算,还是不定期份额折算(有关本基金的份额折算详见本基金合同“二十四、基金份额折算”),其所产生的诺德深证 300 份额不进行自动分离。投资者可选择将上述折算产生的诺德深证 300 份额按 1:1 的比例分拆为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。

(三) 诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的参考净值计算规则

由于诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的风险和收益特性不同,本基金份额所分离的两类基金份额诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额具有不同的参考净值计算规则。

在本基金的存续期内,本基金将在每个工作日按基金合同约定的参考净值计算规则对诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额分别进行参考净值计算,诺德深证 300A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额,本基金净资产优先确保诺德深证 300A 份额的本金及诺德深证 300A 份额累计约定应得收益;诺德深证 300B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额,本基金在优先确保诺德深证 300A 份额的本金及累计约定应得收益后,将剩余净资产计为诺德深证 300B 份额的净资产。

在本基金存续期内,诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的参考净值计算规则如下:

1、诺德深证 300A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3%”,同期银行人民币一年期定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)+3%”。年基准收益均以 1.000 元人民币为基准进行计算;

2、本基金每个工作日对诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额进行参考净值计算。在进行诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额各自的参考净值计算时,本基金净资产优先确保诺德深证 300A 份额的本金及诺德深证 300A 份额累计约定应得收益,之后的剩余净资产计为诺德深证 300B 份额的净资产。诺德深证 300A 份额累计约定应得收益按依据诺德深证 300A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日诺德深证 300A 份额应计收益的天数确定;

3、每 2 份诺德深证 300 份额所代表的资产净值等于 1 份诺德深证 300A 份额和 1 份诺德深证 300B 份额的资产净值之和;

4、在本基金的基金合同生效日所在会计年度或存续的某一完整会计年度内,若未发生

基金合同规定的不定期份额折算，则诺德深证 300A 份额在参考净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或该会计年度年初至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则诺德深证 300A 份额在参考净值计算日应计收益的天数应按照最近一次该会计年度内不定期份额折算基准日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证诺德深证 300A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，诺德深证 300A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

（四）本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值：

1. 诺德深证 300 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日诺德深证 300 份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额的份额数之和。

2. 诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_A = (1 + R)^{t/N}$$
$$NAV_B = \frac{NAV_{300} - 0.5 \times NAV_A}{0.5}$$

设 T 日为基金份额净值计算日， $T=1, 2, 3, \dots, N$ ；N 为当年实际天数； $t=\min\{\text{自年初至 T 日, 自基金合同生效日至 T 日, 自最近一次会计年度内份额折算日至 T 日}\}$ ； NAV_{300} 为 T 日每份诺德深证 300 份额的基金份额净值； NAV_A 为 T 日诺德深证 300A 份额的基金份额参考净值； NAV_B 为 T 日诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值；R 为诺德深证 300A 份额约定年基准收益率。

诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T日的诺德深证300份额净值、诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

五、基金份额的发售与认购

本基金各基金份额初始面值为人民币1.00元，按基金份额初始面值发售。

（一）发售时间

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

（二）发售方式和渠道

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。在基金募集阶段，本基金以同一个基金份额认购代码在场内和场外同时募集。

场外将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售（具体名单详见招募说明书、发售公告及相关公告）。场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售（具体名单详见发售公告或相关业务公告）。本基金认购期结束前获得基金代销业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金诺德深证300A份额和诺德深证300B份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金销售机构对投资者认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

（三）发售对象

本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（四）基金认购费用

本基金认购费率不高于认购金额的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。

（五）认购份数的计算方法

1) 场外认购份额——诺德深证 300 份额的计算

本基金发售结束后，投资者通过场外认购本基金所获得的全部份额将确认为诺德深证 300 份额。

本基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

i) 当认购金额（含认购费）适用于比例费率时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期间的利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

ii) 当认购金额（含认购费）适用于固定金额费用时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期间的利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

2) 场内认购金额和利息折算的份额的计算

本基金场内认购采用份额认购方法，计算公式为：

$$\text{认购金额} = \text{挂牌价格} \times (1 + \text{认购费率}) \times \text{认购份额}$$

$$\text{认购费用} = \text{挂牌价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

$$\text{净认购金额} = \text{挂牌价格} \times \text{认购份额}$$

利息折算的份额=利息/挂牌价格

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

其中，挂牌价格为基金份额发售面值。

3) 本基金的认购费率将按照《运作办法》、《销售办法》的规定，参照行业惯例，结合市场实际情况收取。具体费率详见本基金的招募说明书和发售公告。

4) 诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的计算

本基金在发售结束后将基金份额持有人场内初始有效认购的全部总份额按照 1:1 的比例分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额，则诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的计算公式如下：

诺德深证 300A 份额认购份额=场内认购份额总额×0.5

诺德深证 300B 份额认购份额=场内认购份额总额×0.5

其中，诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的认购份额计算结果以注册登记机构的记录为准。

(六) 募集期间认购资金利息的处理方式

本基金的认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后折算为基金份额，归基金份额持有人所有。其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。

(七) 基金认购的具体规定

投资者认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购份额余额的处理方式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在招募说明书和基金份额发售公告中披露。

(八) 基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。

六、基金的备案

（一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

（二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

（四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

七、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的上市交易

（一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额上市交易。

（二）上市交易的地点

本基金诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额上市交易的地点均为深圳证券交易所。

（三）上市交易的时间

基金合同生效后六个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。

（四）上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1、诺德深证 300 份额所分离的诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额以不同的交易代码上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额参考净值；

2、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

（五）上市交易的费用

诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（六）上市交易的行情揭示

诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值。

(七) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》等相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

(八) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

八、诺德深证 300 份额的申购、赎回与转换

本基金的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额不接受投资者的申购与赎回；本基金的基金合同生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对诺德深证 300 份额进行申购与赎回。

(一) 申购与赎回的场所

投资者办理诺德深证 300 份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理诺德深证 300 份额场内申购、赎回业务。

投资者办理诺德深证 300 份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理诺德深证 300 份额场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理诺德深证 300 份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理诺德深证 300 份额的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、发售公告或基金管理人网站列明。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

(二) 申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

诺德深证 300 份额的申购、赎回开放日为深圳证券交易所的交易日。场内业务办理时间为深圳证券交易所交易日的交易时间，场外业务办理时间以各销售机构的规定为准，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

诺德深证 300 份额的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

诺德深证 300 份额的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 3 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即诺德深证 300 份额的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的诺德深证 300 份额净值为基准进行计算；

2、诺德深证 300 份额采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，认/申购确认日期在先的基金份额先赎回，认/申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理诺德深证 300 份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在至少一种指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者提交申购诺德深证 300 份额申请时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的诺德深证 300 份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日）。在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。否则，如因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实收到申请。申购与赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则对上述业务办理时间进行调整并公告。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关基金销售机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则对上述业务办理时间进行调整并公告。

（五）申购与赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

2、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须依照有关规定在至少一种指定媒介上公告。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

（六）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日诺德深证 300 份额的基金份额净值为基准计算。通过场外方式申购的，申购份额计算结果保留至小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户（返还资金的计算公式及方法见招募说明书）。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

1) 当申购金额（含申购费）适用于比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日诺德深证300份额的基金份额净值}$$

2) 当申购金额（含申购费）适用于固定金额费用时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日诺德深证300份额的基金份额净值}$$

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日诺德深证 300 份额的基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日诺德深证300份额的基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

3、基金管理人在法律法规允许的情况下，可更改上述基金申购份额的计算公式或基金赎回金额的计算公式，以及申购费用、申购份额、余额的处理方式或赎回费、赎回金额的处理方式，但应最迟在新的公式或处理方式适用前 2 个工作日予以公告。

（七）申购和赎回的费用及其用途

1、诺德深证 300 份额申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2、诺德深证 300 份额申购费率、申购份额的具体计算方式、申购份额余额的处理方式、赎回费率、赎回金额的具体计算方法和赎回金额余额的处理方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。

3、诺德深证 300 份额的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

诺德深证 300 份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对持续持有期大于 7 日（含）的投资者收取的赎回费，不低于 25%的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在指定媒介上公告。

（八）申购与赎回的注册登记

1、诺德深证 300 份额的份额采用分系统登记的原则。场外申购的诺德深证 300 份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的诺德深证 300 份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在注册登记系统和证券登记结算系统中的诺德深证 300 份额可通过基金销售机构申请赎回。

3、投资者 T 日申购诺德深证 300 份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分诺德深证 300 份额。

4、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

5、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日中，诺德深证 300 份额的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一开放日基金总份额（包括诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额）的 10%，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额）10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。若发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个基金份额持有人非自动延期办理申请赎回份额占当日非自动延期办理的赎回申请总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上予以公告。

（4）暂停接受和延缓支付：诺德深证 300 份额连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如

基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但延缓期限不得超过 20 个工作日,并应当在中国证监会指定媒介上公告。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者对诺德深证 300 份额的申购申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请;

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请;

(4) 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形;

(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形时;

(7) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或数笔申购。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(5)项情形,基金管理人决定暂停接受申购申请时,应当依法公告。在暂停申购的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者对诺德深证 300 份额的赎回申请:

(1) 因不可抗力导致基金无法正常工作;

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3) 基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,根据本基金合同规定,可以暂停接受赎回申请的情况;

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参

考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应当按规定向中国证监会备案，并按规定公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的诺德深证 300 份额的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的诺德深证 300 份额的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的诺德深证 300 份额的基金份额净值。

(十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供诺德深证 300 份额与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

九、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

（一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的诺德深证 300 份额基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的诺德深证 300 份额或上市交易买入的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的诺德深证 300 份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 1：1 比例申请合并为诺德深证 300 份额后再申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的诺德深证 300 基金份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人进行申请按 1：1 比例分离为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额后在深圳证券交易所上市交易。

（二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理诺德深证 300 份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有诺德深证 300 份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理诺德深证 300 份额场内赎回或诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额上市交易的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、募集期内不得办理系统内转托管。

5、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

（三）跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的诺德深证 300 份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、诺德深证 300 份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

3、募集期内不得办理跨系统转登记。

4、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

十、基金的非交易过户、转托管、定期定额投资计划、冻结与质押

（一）基金的非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金帐户转移到另一投资者基金帐户的行为，或者按照相关法律法规或国家有权机关另有要求的方式进行处理的非交易过户。基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织或者以其他方式处理。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料，基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（二）基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

（三）基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

（四）基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及经注册登记机构认可的符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益一并冻结。

（五）如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

（六）如法律法规、注册登记机构或深圳证券交易所的有关规则发生变化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

十一、基金的份额配对转换

本基金的基金合同生效后，在诺德深证 300A 份额、诺德深证 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。

（一）份额配对转换是指本基金的诺德深证 300 份额与诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份诺德深证 300 份额的场内份额申请转换成一份诺德深证 300A 份额与一份诺德深证 300B 份额的行为。

2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每一份诺德深证 300A 份额与一份诺德深证 300B 份额申请转换成两份诺德深证 300 份额的场内份额的行为。

（二）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

（三）份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒介公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（四）份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请分拆为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的诺德深证 300 份额的场内份额必须是偶数。

3、申请合并为诺德深证 300 份额的诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4、诺德深证 300 份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为诺德深证 300 份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒介公告。

（五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

（六）暂停份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、基金注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

（七）份额配对转换的业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣

金，具体见相关业务办理机构公告。

十二、基金合同当事人及其权利义务

（一）基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：诺德基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 层

法定代表人：潘福祥

成立日期： 2006 年 06 月 08 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]88 号

经营范围：基金管理业务；募集、发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

(18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行

为承担责任；

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

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

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称: 中国银行股份有限公司

住所: 北京市复兴门内大街1号

法定代表人: 陈四清

成立日期: 1983年10月31日

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间: 持续经营

经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保险箱服务; 外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 外币兑换; 国际结算; 同业外汇拆借; 外汇票据的承兑和贴现; 外汇借款; 外汇担保; 结汇、售汇; 发行和代理发行股票以外的外币有价证券; 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券; 自营外汇买卖; 代营外汇买卖; 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款; 资信调查、咨询、见证业务; 组织或参加银团贷款; 国际贵金属买卖; 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务; 在港澳地区

的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- （1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- （2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- （3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。
- （5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
- （6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- （7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- （1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- （2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- （3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- （4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金

管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基

金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

十三、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10、单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 11、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响等其他事项；
- 12、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- 1、调低基金管理费、基金托管费；
- 2、法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3、在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

4、因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5、对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

6、按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；

4、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计持有权益登记日诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不

超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合计持有权益登记日诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后两个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(八) 表决

1、诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(九) 计票

1、现场开会

(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对

大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

(十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法規规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

十四、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

(一) 基金管理人和基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

(1) 基金管理人被依法取消基金管理资格；

(2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；

(3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

(1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；

(2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；

(3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或代表单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在指定媒介上公告。

(4) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或代表单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在指定媒介上公告。

(4) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，基金管理人应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

3、基金管理人与基金托管人同时更换

(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由代表单独或合计持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各自 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

(2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

(3) 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒介上联合公告。

4、新基金管理人接受基金管理或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

十五、基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《诺德深证 300 指数分级证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十六、基金的销售

（一）本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）、定期定额投资和客户服务等业务。

（二）本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

十七、基金份额的注册登记

（一）本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

（二）本基金的注册登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。基金管理人应与中国证券登记结算有限责任公司签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

（三）注册登记机构的权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；

3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；

5、法律法规规定的其他权利。

（四）注册登记机构的义务：

1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；

2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；

5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、法律法规规定的其他义务。

十八、基金的投资

（一）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，以实现了对深证 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。

（二）投资范围

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。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金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%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（三）投资理念

本基金的投资管理将遵循指数化投资理念，以深证 300 指数作为标的指数，通过完全复制的被动式投资管理实现跟踪误差的最小化，从而实现对深证 300 指数的复制。

（四）标的指数

本基金的标的指数是深证 300 价格指数。

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

（五）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。

1、资产配置策略

本基金主要按照深证 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金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%。本基金将根据市场的实际情况、基金资产的流动性要求等因素，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票投资组合构建策略

（1）股票投资组合构建原则

本基金通过完全复制指数的方法，根据深证 300 指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

（2）股票投资组合构建方法

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。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。

（3）股票投资组合调整

本基金所构建的股票投资组合根据深证 300 指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和风险管理中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，力争实现基金净值增长率与深证 300 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

i) 定期调整

当标的指数成份股发生定期调整的时候，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，力求最小化变更成份股带来的跟踪误差。

ii) 临时调整

当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪深证 300 指数；

根据法律法规的规定，成份股在深证 300 指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

iii) 其他调整

本基金将根据市场情况，决定是否参与一级市场新股认购，认购的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

3、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

4、投资绩效评估

在正常市场情况下，本基金力争年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

(六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：深证 300 价格指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

由于本基金的投资标的为深证 300 价格指数，且保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年内的政府国债，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。因此，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

（七）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。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。

从诺德深证 300 份额所分离的两级基金份额来看，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。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- （1）进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （2）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%，法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
- （3）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基

金资产净值 5%的现金或者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；

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金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%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(9) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。

(10) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(11) 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%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(13) 法律法规、中国证监会规定的其他投资比例限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（九）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（3）、（11）、（12）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

十九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

二十、基金的财产

（一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

二十一、基金资产的估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的诺德深证300份额净值，是计算诺德深证300份额申购与赎回价格以及计算诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（四）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(4) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5、股指期货品种将按照相关规定进行估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的结果对外予以公布。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值由基金管理人完成估值后，将估值结果发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认的；
- 3、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的诺德深证 300 份额净值、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

- 1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额任一类别基金份额净值或参考净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额任一类别基金份额净值或参考净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

4、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 4 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

二十二、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；

-
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
 - 8、基金资产的资金汇划费用；
 - 9、基金上市初费及上市月费；
 - 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用费计提方法支付指数许可使用费。

如果指数许可使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告。

4、上述“（一）基金费用的种类”中的第3-10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

二十三、基金收益与分配

（一）收益的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金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。

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。

（二）收益分配

在存续期内，本基金（包括诺德深证300份额、诺德深证300A份额和诺德深证300B份额）将不进行收益分配。

二十四、基金份额折算

（一）定期份额折算

在诺德深证 300A 份额、诺德深证 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，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

1、基金份额折算基准日

每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300 份额。

3、基金份额折算频率

每年折算一次

4、基金份额折算方式

诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额按照本基金合同“四、基金份额的分类与净值计算规则”进行参考净值计算，将诺德深证 300A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份诺德深证 300 份额按照 1 份诺德深证 300A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的份额配比保持 1:1 不变。

对于诺德深证 300A 份额期末的约定应得收益，即诺德深证 300A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内诺德深证 300 份额分配给诺德深证 300A 份额持有人。诺德深证 300 份额持有人持有的每 2 份诺德深证 300 份额将按 1 份诺德深证 300A 份额获得新增诺德深证 300 份额的分配。持有场外诺德深证 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外诺德深证 300 份额的分配；持有场内诺德深证 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内诺德深证 300 份额的分配。经过上述份额折算，诺德深证 300A 份额参考净值和诺德深证 300 份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对诺德深证 300A 份额和诺德深证 300 份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行诺德深证 300A 份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

i) 诺德深证 300A 份额的折算：

定期份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数=定期份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数

$$NAV_{300}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前诺德深证300份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{期末}} - 1.000) \times 0.5 \times NUM_{300}^{\text{前}}}{NUM_{300}^{\text{前}}}$$

诺德深证 300A 份额持有人新增的场内诺德深证 300 份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{期末}} - 1.000)}{NAV_{300}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{300}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后诺德深证 300 份额净值

$NAV_A^{\text{期末}}$ ：每份诺德深证 300A 份额期末参考净值

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前诺德深证 300 份额的份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：定期份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数

ii) 诺德深证 300B 份额的折算：

每个会计年度的定期份额折算不改变诺德深证 300B 的份额参考净值及其份额数。

iii) 诺德深证 300 份额的折算：

$$NAV_{300}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前诺德深证300份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{期末}} - 1.000) \times 0.5 \times NUM_{300}^{\text{前}}}{NUM_{300}^{\text{前}}}$$

诺德深证 300 份额持有人新增的诺德深证 300 份额的份额数

$$= \frac{NUM_{300}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{期末}} - 1.000}{NAV_{300}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{300}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后诺德深证 300 份额净值

$NAV_A^{\text{期末}}$ ：每份诺德深证 300A 份额期末参考净值

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前诺德深证 300 份额的份额数

定期份额折算后诺德深证 300 份额的份额数=定期份额折算前诺德深证 300 份额的份额数+诺德深证 300 份额持有人获得的新增的诺德深证 300 份额的份额数+诺德深证 300A 份额持有人获得的新增的场内诺德深证 300 份额的份额数。

具体内容详见招募说明书。

5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的上市交易和诺德深证 300 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

7、特殊情形的处理

若在某个会计年度最后一个工作日发生基金合同约定的本基金不定期折算情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，可以根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

（二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

1、当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

（1）基金份额折算基准日

当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

（2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额。

（3）基金份额折算频率

不定期。

（4）基金份额折算方式

当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，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。

当诺德深证 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

i) 诺德深证 300A 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数与份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数相等；
- 诺德深证 300A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1.000 元以上的参考净值部分全部折算为场内诺德深证 300 份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

诺德深证 300A 份额持有人新增的场内诺德深证 300 份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300A 份额参考净值

ii) 诺德深证 300B 份额的折算：

- 份额折算后的诺德深证 300B 份额与诺德深证 300A 份额的份额数保持 1: 1 配比；
- 份额折算前的诺德深证 300B 份额资产净值等于份额折算后的诺德深证 300B 份额资产净值与份额折算后新增场内诺德深证 300 份额的资产净值之和；
- 份额折算前诺德深证 300B 份额的持有人在份额折算后将持有诺德深证 300B 份额与新增的场内诺德深证 300 份额。

$$NUM_B^{\text{后}} = NUM_A^{\text{后}}$$

诺德深证 300B 份额持有人新增的场内诺德深证 300 份额的份额数

$$= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300B 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额参考净值

iii) 诺德深证 300 份额的折算：

份额折算原则：

- 场外的诺德深证 300 份额持有人折算后获得新增的场外诺德深证 300 份额，场内的诺德深证 300 份额持有人折算后获得新增的场内诺德深证 300 份额。

$$NUM_{300}^{\text{后}} = \frac{NAV_{300}^{\text{前}} \times NUM_{300}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{300}^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300 份额的份额数

$NAV_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额净值

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额的份额数

具体内容详见《招募说明书》。

(5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的

上市交易和诺德深证 300 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

2、当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

(1) 基金份额折算基准日

当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，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。

当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

i) 诺德深证 300B 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前诺德深证 300B 份额的资产净值与份额折算后诺德深证 300B 份额的资产净值相等；

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额的份额数

ii) 诺德深证 300A 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前后深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比；
- 份额折算前深证 300A 份额的资产净值与份额折算后深证 300A 份额的资产净值及新增场内诺德深证 300 份额的资产净值之和相等
- 份额折算前诺德深证 300A 份额的持有人在份额折算后将持有诺德深证 300A 份额与新增场内诺德深证 300 份额；

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

诺德深证 300A 份额持有人新增的场内诺德深证 300 份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300B 份额的份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300A 份额参考净值

iii) 诺德深证 300 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前诺德深证 300 份额的资产净值与份额折算后诺德深证 300 份额的资产净值相等；

$$NUM_{300}^{\text{后}} = \frac{NAV_{300}^{\text{前}} \times NUM_{300}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{300}^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300 份额的份额数

$NAV_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额净值

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额的份额数

具体内容详见《招募说明书》。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的上市交易和诺德深证 300 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

二十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

二十六、基金的信息披露

（一）、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

(四)、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

(五)、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议

(1)、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益事项的法律文件。

(2)、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(3)、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

(4)、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明

书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、《上市交易公告书》

诺德深证300A份额、诺德深证300B份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在诺德深证300A份额、诺德深证300B份额上市交易3个工作日前，将上市交易公告书登载在指定媒介上。

5、基金净值信息公告

基金合同生效后，在诺德深证300A份额和诺德深证300B份额两类份额开始上市交易或者诺德深证300份额开始办理申购赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次诺德深证300份额净值、诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值和基金份额累计净值。

在诺德深证300A份额和诺德深证300B份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的诺德深证300份额净值、诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的诺德深证300份额净值、诺德深证300A份额参考净值、诺德深证300B份额参考净值和基金份额累计净值。

6、诺德深证300份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明诺德深证300份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

8、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

- (1)、基金份额持有人大会的召开；
- (2)、基金合同终止、基金清算；
- (3)、转换基金运作方式、基金合并；
- (4)、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5)、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6)、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7)、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8)、基金募集期延长或提前结束募集；
- (9)、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人

发生变动；

- (10)、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；
- (11)、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；
- (12)、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (13)、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (14)、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- (15)、管理费、托管费、诺德深证 300 份额的申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (16)、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- (17)、诺德深证 300 份额开始办理申购、赎回；
- (18)、基金发生巨额赎回并延期办理；
- (19)、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (20)、诺德深证 300 份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (21)、本基金开始办理或暂停接受配对转换申请；
- (22)、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- (23)、本基金实施基金份额折算；
- (24)、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额上市交易；
- (25)、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- (26)、基金份额持有人大会的决议；
- (27)、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等的重大事项；

(28)、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

9、公开澄清

在基金合同期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告。

11、清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

12、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控,并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护,提升信息披露服务质量,基金管理人应当按照中国证监会规定向投

投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

13、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，以供社会公众查阅、复制，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

二十七 基金的业务规则

基金份额持有人应遵守基金托管人、基金管理人及其代理销售机构、注册登记机构和相关证券交易所的相关交易及业务规则。

二十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关的程序后，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止情形发生后，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

(4) 对基金财产进行评估和变现；

(5) 制作清算报告；

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额各自的应计分配比例，并据此由诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

7、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，

律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。清算过程中的有关重大事项须及时公告。

8、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十九、违约责任

（一）因基金管理人或基金托管人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

（二）基金合同当事人违反本基金合同，给基金财产或其他基金合同当事人造成损失的，应承担相应的赔偿责任。

（三）发生下列情况时，当事人可以免责：

1、基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

2、在无过错情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

3、不可抗力。基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本合同的，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任，但法律另有规定的除外。任何一方迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。

（四）在发生一方或多方当事人违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。

（五）本基金合同当事人一方违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

三十、争议的处理

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过

友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三)除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

三十一、基金合同的效力

(一)本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

(二)本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三)本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(四)本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

(五)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

(以下无正文)

（本页为《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》签署页，无正文）

基金管理人：诺德基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：

基金托管人：中国银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：