

# 诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 27 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 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.....	11
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.....	12
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 托管人对本中期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.....	48
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的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>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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	4,940,389.57 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	1,296,711.00 份	1,296,711.00 份	2,346,967.57 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	<p>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。</p> <p>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。</p>		
业绩比较基准	深证 300 价格指数收益率 $\times$ 95% + 金融同业存款利率 $\times$ 5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
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	许俊
	联系电话	021-68985058	010-66594319
	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	870,593.90
本期利润	534,962.88
加权平均基金份额本期利润	0.0830
本期加权平均净值利润率	9.80%
本期基金份额净值增长率	8.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	802,296.40
期末可供分配基金份额利润	0.1624
期末基金资产净值	4,492,979.18
期末基金份额净值	0.909
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	44.30%

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	8.21%	0.87%	11.21%	0.95%	-3.00%	-0.08%
过去三个月	16.39%	0.93%	19.76%	1.06%	-3.37%	-0.13%
过去六个月	8.88%	1.69%	14.28%	1.73%	-5.40%	-0.04%
过去一年	20.55%	1.36%	30.25%	1.39%	-9.70%	-0.03%
过去三年	-4.01%	1.36%	18.32%	1.40%	-22.33%	-0.04%
自基金合同	44.30%	1.57%	85.11%	1.55%	-40.81%	0.02%

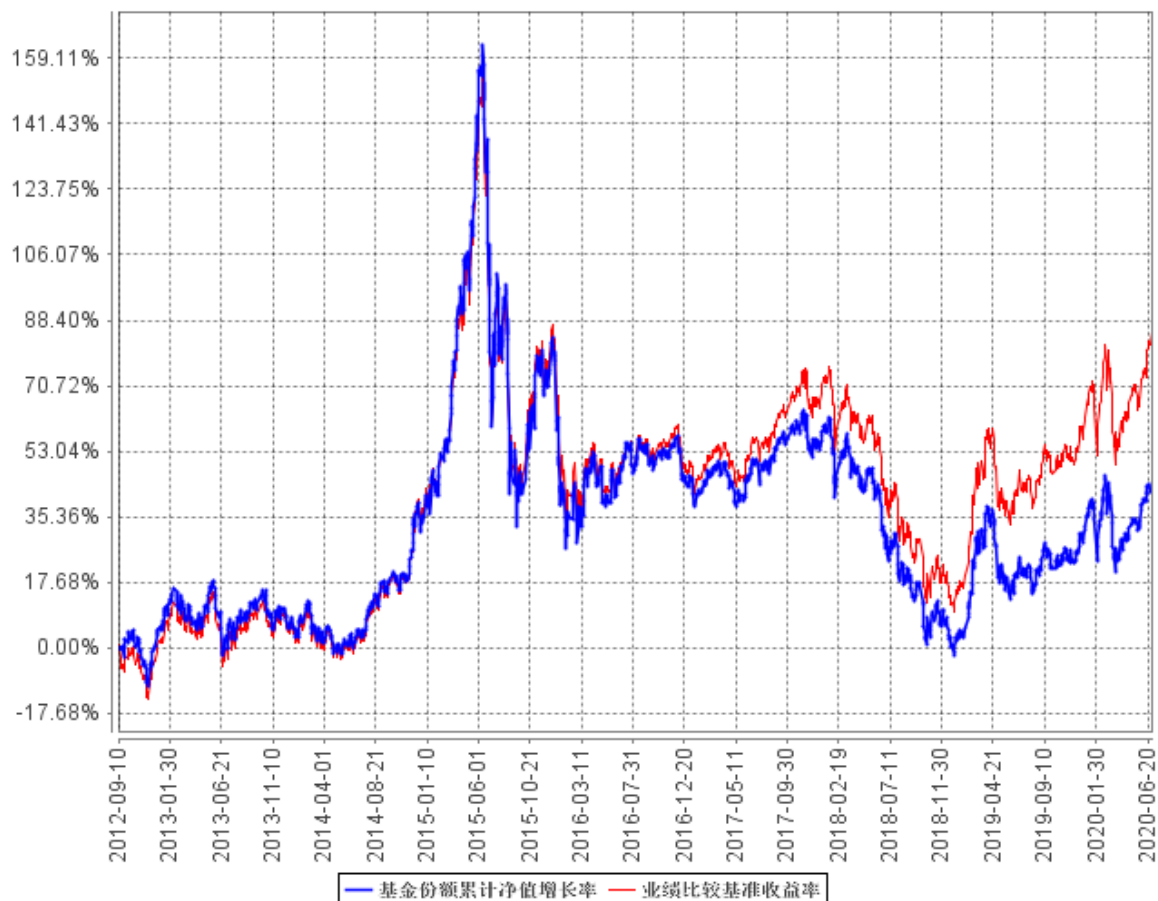


生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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 2020 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，公司管理了二十五只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选30混合型证券投资基金、诺德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、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新100指数型证券投资基金以及诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金(FOF)、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金。

#### 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的基金经理	2017年4月5日	-	12	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处理等事件，使得本基金的年化波动率控制在与业绩基准基本相当的水平。

报告期内，本基金遵循被动化指数投资策略，努力控制净值表现与业绩基准的偏差。从实际效果来看，报告期内本基金与业绩基准收益的偏差主要来源于股票分红、停牌复牌和三位小数净值四舍五入等原因所带来的跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.909 元，累计净值为 1.773 元。本报告期份额净值增长率为 8.88%，同期业绩比较基准增长率为 14.28%。

#### 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。本基金份额持有人大会已于 2020 年 6 月 22 日表决通过《关于终止诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

## § 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	512,108.39	386,877.75
结算备付金		42,358.67	-
存出保证金		1,246.98	114.09
交易性金融资产	6.4.7.2	4,154,370.77	4,932,215.10
其中：股票投资		4,154,370.77	4,932,215.10
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	72.40	84.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,710,157.21	5,319,291.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		93,438.73	41,359.44
应付管理人报酬		3,977.04	4,278.78
应付托管费		795.44	855.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,788.94	841.29
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	110,177.88	60,078.60
负债合计		217,178.03	107,413.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,113,668.89	3,936,177.43
未分配利润	6.4.7.10	1,379,310.29	1,275,700.14
所有者权益合计		4,492,979.18	5,211,877.57
负债和所有者权益总计		4,710,157.21	5,319,291.44

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.909 元，基金份额总额 4,940,389.57 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		779,451.92	1,179,261.03
1.利息收入		1,862.99	1,810.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,862.99	1,406.38
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
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,104,610.80	-276,116.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,061,471.60	-310,365.91
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	43,139.20	34,249.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-335,631.02	1,448,393.94
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	8,609.15	5,173.27
<b>减：二、费用</b>		244,489.04	199,699.28

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,922.97	24,748.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,384.60	4,949.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,352.28	9,845.81
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	195,829.19	160,155.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		534,962.88	979,561.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		534,962.88	979,561.75

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	3,936,177.43	1,275,700.14	5,211,877.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	534,962.88	534,962.88
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）	-822,508.54	-431,352.73	-1,253,861.27
其中：1.基金申购款	4,644,634.39	1,581,910.81	6,226,545.20
2.基金赎回款	-5,467,142.93	-2,013,263.54	-7,480,406.47
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）	3,113,668.89	1,379,310.29	4,492,979.18
项目	上年度可比期间 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

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达到 2.000 元，或当诺德 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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%。

根据《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》、基金管理人发布的《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 22 日表决通过了《关于终止诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

根据基金管理人于 2020 年 6 月 29 日发布的《关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额终止上市的公告》，基金管理人诺德基金管理有限公司已向深交所申请终止本基金诺德 300A 份额和诺德 300B 份额的上市交易，并获得深交所深证上[2020]555 号《终止上市通知书》同意，本基金终止上市的权益登记日为 2020 年 7 月 1 日，终止上市日为 2020 年 7 月 2 日。本基金的最后运作日为 2020 年 7 月 1 日，并自 2020 年 7 月 2 日起进入清算程序。

#### 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<年度报告和中期报告>》、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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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：

(a) 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	512,108.39
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：	512,108.39

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,844,428.03	4,154,370.77	309,942.74
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	3,844,428.03	4,154,370.77	309,942.74

### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	52.70
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	19.10
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	-
应收出借证券利息	-
其他	0.60
合计	72.40

**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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,788.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,788.94

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	177.88
应付证券出借违约金	-
预提费用	60,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	110,177.88

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,084,992.70	3,936,177.43
本期申购	7,371,515.82	4,644,634.39
本期赎回(以“-”号填列)	-8,677,161.21	-5,467,142.93
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	161,042.26	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,940,389.57	3,113,668.89

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	-56,082.25	1,331,782.39	1,275,700.14
本期利润	870,593.90	-335,631.02	534,962.88
本期基金份额交易产生的变动数	-12,215.25	-419,137.48	-431,352.73
其中：基金申购款	-20,868.31	1,602,779.12	1,581,910.81
基金赎回款	8,653.06	-2,021,916.60	-2,013,263.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	802,296.40	577,013.89	1,379,310.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	1,782.09
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	58.33
其他	22.57
合计	1,862.99

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	5,884,759.19
减：卖出股票成本总额	4,823,287.59
买卖股票差价收入	1,061,471.60

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	43,139.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	43,139.20



**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-335,631.02
——股票投资	-335,631.02
——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	-335,631.02

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	8,609.15
合计	8,609.15

注：1. 本基金的场外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)的投资人收取的赎回费，不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

2. 场内赎回费率为固定赎回费率0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	16,352.28
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	16,352.28

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
基金上市费	35,000.00
指数使用费	100,000.00
律师费	20,000.00
公证费	10,000.00
银行费用	829.19
合计	195,829.19

#### 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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,922.97	24,748.21
其中：支付销售机构的客户维护费	5,753.39	5,389.96

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,384.60	4,949.70

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 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**

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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	512,108.39	1,782.09	377,993.50	1,373.21

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。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

## 6.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股未上市	5.00	6.54	623	3,115.00	4,074.42	-

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	*ST 康得	2019 年 7 月 8 日	重大事项	-	-	-	2,697	38,886.97	-	-
002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	退市风险警示	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	1,470	8,878.84	3,336.90	-

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有转融通证券出借业务的证券。

## 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 2020 年 6 月 30 日,本基金无债券投资(2019 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 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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时间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公司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，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 2020 年 6 月 30	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
----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----



日							
资产							
银行存款	512,108.39	-	-	-	-	-	512,108.39
结算备付金	42,358.67	-	-	-	-	-	42,358.67
存出保证金	1,246.98	-	-	-	-	-	1,246.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,154,370.77	4,154,370.77
应收利息	-	-	-	-	-	72.40	72.40
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	555,714.04	-	-	-	-	4,154,443.17	4,710,157.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	93,438.73	93,438.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,977.04	3,977.04
应付托管费	-	-	-	-	-	795.44	795.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,788.94	8,788.94
其他负债	-	-	-	-	-	110,177.88	110,177.88
负债总计	-	-	-	-	-	217,178.03	217,178.03
利率敏感度缺口	555,714.04	-	-	-	-	3,937,265.14	4,492,979.18
上年度末 2019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	386,877.75	-	-	-	-	-	386,877.75
存出保证金	114.09	-	-	-	-	-	114.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,932,215.10	4,932,215.10
应收利息	-	-	-	-	-	84.50	84.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	386,991.84	-	-	-	-	4,932,299.60	5,319,291.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,359.44	41,359.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,278.78	4,278.78
应付托管费	-	-	-	-	-	855.76	855.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	841.29	841.29
其他负债	-	-	-	-	-	60,078.60	60,078.60
负债总计	-	-	-	-	-	107,413.87	107,413.87
利率敏感度缺口	386,991.84	-	-	-	-	4,824,885.73	5,211,877.57

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

予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券（2019 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（2019 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	4,154,370.77	92.46	4,932,215.10	94.63
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	4,154,370.77	92.46	4,932,215.10	94.63

#### 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	228,648.00	255,773.00
沪深 300 指数下降 5%	-228,648.00	-255,773.00	

#### 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	4,154,370.77	88.20
	其中：股票	4,154,370.77	88.20
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	554,467.06	11.77
8	其他各项资产	1,319.38	0.03
9	合计	4,710,157.21	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	66,937.00	1.49
B	采矿业	32,827.34	0.73
C	制造业	2,443,246.16	54.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,368.92	0.81
E	建筑业	21,735.84	0.48
F	批发和零售业	53,849.80	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	44,473.43	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	489,729.79	10.90
J	金融业	273,658.91	6.09
K	房地产业	243,976.58	5.43
L	租赁和商务服务业	40,675.74	0.91
M	科学研究和技术服务业	34,431.32	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	33,346.80	0.74

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,147.50	0.43
Q	卫生和社会工作	22,053.92	0.49
R	文化、体育和娱乐业	45,936.23	1.02
S	综合	24,551.35	0.55
	合计	3,926,946.63	87.40

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	139,288.40	3.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,298.28	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,752.78	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	38,783.10	0.86
J	金融业	4,515.84	0.10
K	房地产业	2,187.36	0.05
L	租赁和商务服务业	5,360.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,656.92	0.21
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	15,581.46	0.35
S	综合	-	-
	合计	227,424.14	5.06

### 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	000661	长春高新	230	100,119.00	2.23
2	001979	招商蛇口	3,862	63,491.28	1.41
3	002131	利欧股份	14,600	56,356.00	1.25
4	000858	五粮液	276	47,229.12	1.05
5	000333	美的集团	747	44,663.13	0.99
6	300433	蓝思科技	1,494	41,891.76	0.93
7	300033	同花顺	298	39,657.84	0.88
8	300408	三环集团	1,386	38,392.20	0.85
9	000651	格力电器	675	38,184.75	0.85
10	002916	深南电路	200	33,504.00	0.75
11	002065	东华软件	2,521	31,562.92	0.70
12	002385	大北农	3,397	30,946.67	0.69
13	300676	华大基因	196	30,558.36	0.68
14	002179	中航光电	742	30,429.42	0.68
15	300088	长信科技	2,672	29,926.40	0.67
16	002475	立讯精密	581	29,834.35	0.66
17	000069	华侨城A	4,922	29,827.32	0.66
18	300285	国瓷材料	890	29,823.90	0.66
19	000625	长安汽车	2,711	29,821.00	0.66
20	000596	古井贡酒	196	29,447.04	0.66
21	002157	正邦科技	1,684	29,436.32	0.66
22	002465	海格通信	2,178	28,183.32	0.63
23	300558	贝达药业	196	27,436.08	0.61
24	000895	双汇发展	594	27,377.46	0.61
25	002223	鱼跃医疗	751	27,336.40	0.61
26	300450	先导智能	591	27,310.11	0.61
27	002405	四维图新	1,646	27,142.54	0.60
28	000963	华东医药	1,062	26,868.60	0.60
29	002466	天齐锂业	1,168	26,805.60	0.60
30	002493	荣盛石化	2,176	26,764.80	0.60
31	002422	科伦药业	1,257	26,397.00	0.59
32	002075	沙钢股份	2,078	25,975.00	0.58
33	002602	世纪华通	1,672	25,598.32	0.57

34	000786	北新建材	1,186	25,297.38	0.56
35	002340	格林美	5,018	24,939.46	0.56
36	000009	中国宝安	2,885	24,551.35	0.55
37	300207	欣旺达	1,286	24,305.40	0.54
38	002600	领益智造	2,276	24,193.88	0.54
39	000988	华工科技	988	24,136.84	0.54
40	002601	龙麟佰利	1,286	23,791.00	0.53
41	000656	金科股份	2,915	23,786.40	0.53
42	002373	千方科技	990	23,750.10	0.53
43	000750	国海证券	5,458	23,687.72	0.53
44	000513	丽珠集团	482	23,140.82	0.52
45	300496	中科创达	294	22,843.80	0.51
46	002019	亿帆医药	988	22,694.36	0.51
47	300271	华宇软件	792	22,342.32	0.50
48	002138	顺络电子	890	22,205.50	0.49
49	300168	万达信息	988	21,805.16	0.49
50	000728	国元证券	2,592	21,772.80	0.48
51	000002	万 科 A	824	21,539.36	0.48
52	002507	涪陵榨菜	594	21,389.94	0.48
53	300024	机器人	1,563	21,366.21	0.48
54	300750	宁德时代	122	21,271.92	0.47
55	002212	南洋股份	792	21,051.36	0.47
56	002252	上海莱士	2,465	20,853.90	0.46
57	000423	东阿阿胶	581	20,805.61	0.46
58	000961	中南建设	2,325	20,692.50	0.46
59	002797	第一创业	2,988	20,676.96	0.46
60	300017	网宿科技	2,431	20,639.19	0.46
61	300146	汤臣倍健	1,025	20,182.25	0.45
62	002152	广电运通	1,537	19,888.78	0.44
63	002511	中顺洁柔	890	19,847.00	0.44
64	300418	昆仑万维	792	19,768.32	0.44
65	002120	韵达股份	807	19,731.15	0.44
66	002414	高德红外	673	19,705.44	0.44
67	300316	晶盛机电	792	19,594.08	0.44
68	002180	纳思达	594	19,548.54	0.44
69	002508	老板电器	623	19,381.53	0.43
70	002714	牧原股份	236	19,352.00	0.43
71	002353	杰瑞股份	623	19,313.00	0.43
72	002607	中公教育	690	19,147.50	0.43

73	002572	索菲亚	792	19,142.64	0.43
74	000547	航天发展	1,400	19,138.00	0.43
75	000401	冀东水泥	1,186	19,023.44	0.42
76	002926	华西证券	1,782	18,942.66	0.42
77	002673	西部证券	2,285	18,645.60	0.41
78	300009	安科生物	1,037	18,562.30	0.41
79	000998	隆平高科	1,108	18,448.20	0.41
80	300058	蓝色光标	2,365	18,447.00	0.41
81	300059	东方财富	908	18,341.60	0.41
82	000050	深天马 A	1,191	18,293.76	0.41
83	300070	碧水源	2,233	18,131.96	0.40
84	002146	荣盛发展	2,223	18,006.30	0.40
85	002013	中航机电	2,278	17,996.20	0.40
86	000623	吉林敖东	1,125	17,696.25	0.39
87	002500	山西证券	2,701	17,664.54	0.39
88	000703	恒逸石化	1,929	17,611.77	0.39
89	300699	光威复材	274	17,188.02	0.38
90	000001	平安银行	1,342	17,177.60	0.38
91	300760	迈瑞医疗	56	17,119.20	0.38
92	300274	阳光电源	1,186	17,066.54	0.38
93	000975	银泰黄金	1,088	17,059.84	0.38
94	000725	京东方 A	3,636	16,980.12	0.38
95	002078	太阳纸业	1,782	16,964.64	0.38
96	000540	中天金融	5,172	16,653.84	0.37
97	002195	二三四五	5,820	16,354.20	0.36
98	002281	光迅科技	494	16,232.84	0.36
99	000999	华润三九	543	15,850.17	0.35
100	000686	东北证券	1,874	15,835.30	0.35
101	000997	新大陆	986	15,756.28	0.35
102	002415	海康威视	515	15,630.25	0.35
103	300498	温氏股份	706	15,390.80	0.34
104	000630	铜陵有色	7,966	15,374.38	0.34
105	002294	信立泰	515	15,274.90	0.34
106	002268	卫士通	712	15,194.08	0.34
107	300113	顺网科技	594	15,087.60	0.34
108	002382	蓝帆医疗	496	14,934.56	0.33
109	002939	长城证券	1,186	14,611.52	0.33
110	000581	威孚高科	706	14,600.08	0.32
111	000413	东旭光电	5,444	14,535.48	0.32



112	002153	石基信息	372	14,519.16	0.32
113	300001	特锐德	692	14,490.48	0.32
114	002739	万达电影	939	14,338.53	0.32
115	002081	金螳螂	1,792	14,085.12	0.31
116	000063	中兴通讯	350	14,045.50	0.31
117	300296	利亚德	2,300	13,961.00	0.31
118	002032	苏泊尔	196	13,916.00	0.31
119	002080	中材科技	890	13,795.00	0.31
120	002299	圣农发展	474	13,746.00	0.31
121	300251	光线传媒	1,225	13,364.75	0.30
122	000671	阳光城	2,080	13,187.20	0.29
123	002217	合力泰	2,500	13,125.00	0.29
124	002812	恩捷股份	196	12,896.80	0.29
125	002368	太极股份	294	12,844.86	0.29
126	002151	北斗星通	396	12,683.88	0.28
127	002773	康弘药业	255	12,648.00	0.28
128	000060	中金岭南	3,372	12,543.84	0.28
129	300166	东方国信	1,008	12,509.28	0.28
130	002056	横店东磁	1,088	12,240.00	0.27
131	300357	我武生物	196	12,201.00	0.27
132	300188	美亚柏科	594	11,779.02	0.26
133	000878	云南铜业	1,097	11,639.17	0.26
134	002925	盈趣科技	200	11,588.00	0.26
135	000778	新兴铸管	3,311	11,356.73	0.25
136	000709	河钢股份	5,542	11,305.68	0.25
137	000960	锡业股份	1,306	11,179.36	0.25
138	002304	洋河股份	106	11,144.84	0.25
139	000598	兴蓉环境	2,417	11,118.20	0.25
140	002142	宁波银行	420	11,033.40	0.25
141	000729	燕京啤酒	1,582	10,836.70	0.24
142	000738	航发控制	792	10,810.80	0.24
143	000100	TCL 科技	1,740	10,788.00	0.24
144	000402	金融街	1,594	10,584.16	0.24
145	002038	双鹭药业	821	10,517.01	0.23
146	000830	鲁西化工	1,384	10,324.64	0.23
147	002690	美亚光电	196	10,309.60	0.23
148	002558	巨人网络	592	10,300.80	0.23
149	002410	广联达	147	10,245.90	0.23
150	002064	华峰氨纶	2,000	10,140.00	0.23

151	000629	攀钢钒钛	4,950	9,949.50	0.22
152	002399	海普瑞	396	9,915.84	0.22
153	002110	三钢闽光	1,484	9,883.44	0.22
154	002938	鹏鼎控股	196	9,811.76	0.22
155	002191	劲嘉股份	1,088	9,694.08	0.22
156	000983	西山煤电	2,572	9,645.00	0.21
157	002085	万丰奥威	1,486	9,629.28	0.21
158	002595	豪迈科技	494	9,613.24	0.21
159	300133	华策影视	1,325	9,606.25	0.21
160	000825	太钢不锈	2,872	9,535.04	0.21
161	000568	泸州老窖	104	9,476.48	0.21
162	000564	供销大集	2,080	9,339.20	0.21
163	300180	华峰超纤	1,088	9,313.28	0.21
164	002506	协鑫集成	3,564	9,302.04	0.21
165	000039	中集集团	1,275	9,218.25	0.21
166	300142	沃森生物	176	9,215.36	0.21
167	002230	科大讯飞	244	9,132.92	0.20
168	000089	深圳机场	1,186	9,084.76	0.20
169	000807	云铝股份	2,078	9,060.08	0.20
170	000338	潍柴动力	660	9,055.20	0.20
171	002092	中泰化学	1,991	9,019.23	0.20
172	000563	陕国投A	2,376	8,814.96	0.20
173	000723	美锦能源	1,400	8,764.00	0.20
174	002594	比亚迪	122	8,759.60	0.19
175	000883	湖北能源	2,474	8,708.48	0.19
176	002027	分众传媒	1,562	8,700.34	0.19
177	002010	传化智联	1,584	8,616.96	0.19
178	000932	华菱钢铁	2,276	8,580.52	0.19
179	300015	爱尔眼科	196	8,516.20	0.19
180	003816	中国广核	2,872	8,501.12	0.19
181	000839	中信国安	3,483	8,289.54	0.18
182	002583	海能达	1,090	8,273.10	0.18
183	002241	歌尔股份	281	8,250.16	0.18
184	000559	万向钱潮	1,700	8,228.00	0.18
185	002670	国盛金控	892	8,161.80	0.18
186	000967	盈峰环境	988	8,151.00	0.18
187	002372	伟星新材	692	8,047.96	0.18
188	000027	深圳能源	1,733	8,041.12	0.18
189	300347	泰格医药	78	7,946.64	0.18

190	002007	华兰生物	158	7,917.38	0.18
191	002936	郑州银行	2,286	7,863.84	0.18
192	000046	泛海控股	2,071	7,807.67	0.17
193	002555	三七互娱	164	7,675.20	0.17
194	002310	东方园林	1,584	7,650.72	0.17
195	002745	木林森	496	7,643.36	0.17
196	300122	智飞生物	76	7,611.40	0.17
197	000876	新希望	255	7,599.00	0.17
198	002156	通富微电	300	7,515.00	0.17
199	300124	汇川技术	197	7,484.03	0.17
200	000930	中粮科技	1,086	7,417.38	0.17
201	000898	鞍钢股份	2,992	7,330.40	0.16
202	002242	九阳股份	196	7,304.92	0.16
203	000028	国药一致	162	7,291.62	0.16
204	002244	滨江集团	1,682	7,182.14	0.16
205	000627	天茂集团	1,378	7,179.38	0.16
206	000301	东方盛虹	1,286	7,150.16	0.16
207	002352	顺丰控股	130	7,111.00	0.16
208	000826	启迪环境	952	7,063.84	0.16
209	000987	越秀金控	596	6,949.36	0.15
210	000776	广发证券	483	6,819.96	0.15
211	000166	申万宏源	1,336	6,746.80	0.15
212	300014	亿纬锂能	139	6,651.15	0.15
213	002302	西部建设	692	6,643.20	0.15
214	000732	泰禾集团	1,288	6,555.92	0.15
215	000021	深科技	300	6,549.00	0.15
216	000031	大悦城	1,284	6,535.56	0.15
217	300072	三聚环保	1,519	6,501.32	0.14
218	002831	裕同科技	235	6,464.85	0.14
219	300003	乐普医疗	176	6,427.52	0.14
220	300136	信维通信	120	6,362.40	0.14
221	002271	东方雨虹	154	6,257.02	0.14
222	002128	露天煤业	790	6,122.50	0.14
223	300253	卫宁健康	264	6,056.16	0.13
224	002460	赣锋锂业	108	5,785.56	0.13
225	300413	芒果超媒	88	5,737.60	0.13
226	002129	中环股份	252	5,659.92	0.13
227	002044	美年健康	388	5,591.08	0.12
228	002563	森马服饰	792	5,583.60	0.12

229	002456	欧菲光	291	5,351.49	0.12
230	001965	招商公路	792	5,330.16	0.12
231	002653	海思科	200	5,322.00	0.12
232	002236	大华股份	276	5,301.96	0.12
233	002384	东山精密	166	4,971.70	0.11
234	002127	南极电商	232	4,911.44	0.11
235	000860	顺鑫农业	86	4,900.28	0.11
236	300601	康泰生物	30	4,864.80	0.11
237	002821	凯莱英	20	4,860.00	0.11
238	002008	大族激光	135	4,853.25	0.11
239	002050	三花智控	211	4,620.90	0.10
240	000553	安道麦 A	494	4,455.88	0.10
241	000157	中联重科	691	4,443.13	0.10
242	002867	周大生	200	4,434.00	0.10
243	002624	完美世界	76	4,380.64	0.10
244	002463	沪电股份	174	4,346.52	0.10
245	002024	苏宁易购	494	4,332.38	0.10
246	000977	浪潮信息	110	4,309.80	0.10
247	002185	华天科技	309	4,180.77	0.09
248	002001	新和成	142	4,132.20	0.09
249	002439	启明星辰	98	4,122.86	0.09
250	300383	光环新网	154	4,014.78	0.09
251	002202	金风科技	399	3,978.03	0.09
252	300012	华测检测	196	3,872.96	0.09
253	000538	云南白药	41	3,846.21	0.09
254	000783	长江证券	570	3,841.80	0.09
255	000425	徐工机械	634	3,746.94	0.08
256	002396	星网锐捷	100	3,533.00	0.08
257	002736	国信证券	308	3,480.40	0.08
258	002371	北方华创	20	3,418.20	0.08
259	000708	中信特钢	200	3,418.00	0.08
260	002966	苏州银行	400	3,352.00	0.07
261	000768	中航飞机	183	3,246.42	0.07
262	000066	中国长城	244	3,220.80	0.07
263	002468	申通快递	196	3,216.36	0.07
264	001914	招商积余	100	3,073.00	0.07
265	300144	宋城演艺	167	2,889.10	0.06
266	000537	广宇发展	392	2,861.60	0.06
267	002311	海大集团	57	2,712.63	0.06

268	000959	首钢股份	588	2,528.40	0.06
269	002958	青农商行	392	1,736.56	0.04
270	000785	居然之家	200	1,584.00	0.04
271	002948	青岛银行	294	1,496.46	0.03
272	002625	光启技术	196	1,421.00	0.03
273	000617	中油资本	98	1,018.22	0.02
274	002074	国轩高科	36	966.24	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002030	达安基因	524	14,294.72	0.32
2	300315	掌趣科技	1,813	13,289.29	0.30
3	300073	当升科技	392	12,963.44	0.29
4	002273	水晶光电	694	11,895.16	0.26
5	002709	天赐材料	320	10,812.80	0.24
6	300036	超图软件	392	9,870.56	0.22
7	002168	惠程科技	980	8,045.80	0.18
8	002221	东华能源	882	7,752.78	0.17
9	002635	安洁科技	300	7,470.00	0.17
10	000877	天山股份	490	7,399.00	0.16
11	000970	中科三环	696	6,806.88	0.15
12	002597	金禾实业	294	6,753.18	0.15
13	002497	雅化集团	686	6,331.78	0.14
14	000503	国新健康	564	6,282.96	0.14
15	000793	华闻集团	1,422	5,858.64	0.13
16	002183	怡亚通	1,000	5,360.00	0.12
17	300182	捷成股份	1,322	5,274.78	0.12
18	002407	多氟多	490	5,213.60	0.12
19	000488	晨鸣纸业	1,029	5,083.26	0.11
20	300459	金科文化	1,441	4,971.45	0.11
21	000528	柳工	784	4,947.04	0.11
22	002839	张家港行	784	4,515.84	0.10
23	300027	华谊兄弟	1,212	4,448.04	0.10
24	000008	神州高铁	1,372	4,033.68	0.09
25	000933	神火股份	882	3,660.30	0.08
26	000717	韶钢松山	882	3,351.60	0.07

27	002470	金正大	1,470	3,336.90	0.07
28	000059	华锦股份	686	3,100.72	0.07
29	002665	首航高科	1,254	3,059.76	0.07
30	002491	通鼎互联	588	3,010.56	0.07
31	300377	赢时胜	294	2,745.96	0.06
32	300197	铁汉生态	1,078	2,738.12	0.06
33	002573	清新环境	490	2,675.40	0.06
34	300355	蒙草生态	980	2,636.20	0.06
35	000040	东旭蓝天	784	2,304.96	0.05
36	002285	世联行	784	2,187.36	0.05
37	002358	森源电气	400	1,996.00	0.04
38	000539	粤电力A	588	1,993.32	0.04
39	002366	台海核电	392	1,658.16	0.04
40	002280	*ST 联络	1,127	1,622.88	0.04
41	300266	兴源环境	490	1,607.20	0.04
42	300222	科大智能	196	1,589.56	0.04
43	002411	延安必康	196	1,324.96	0.03
44	300159	新研股份	294	1,149.54	0.03
45	002450	*ST 康得	2,697	0.00	-

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	226,351.00	4.34
2	000333	美的集团	203,778.00	3.91
3	000858	五粮液	174,540.00	3.35
4	002475	立讯精密	103,643.00	1.99
5	000002	万科A	102,508.00	1.97
6	000001	平安银行	87,456.00	1.68
7	300750	宁德时代	85,976.00	1.65
8	300760	迈瑞医疗	83,403.00	1.60
9	300498	温氏股份	81,109.00	1.56
10	002415	海康威视	72,671.00	1.39
11	000725	京东方A	68,763.00	1.32
12	000063	中兴通讯	65,594.00	1.26

13	300059	东方财富	64,434.00	1.24
14	002131	利欧股份	59,997.00	1.15
15	002714	牧原股份	59,700.00	1.15
16	002142	宁波银行	45,368.00	0.87
17	000338	潍柴动力	43,212.00	0.83
18	000100	TCL 科技	42,219.00	0.81
19	000876	新 希 望	41,326.00	0.79
20	300015	爱尔眼科	38,696.00	0.74

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	398,869.17	7.65
2	000333	美的集团	365,498.08	7.01
3	000858	五 粮 液	345,480.60	6.63
4	002475	立讯精密	203,502.24	3.90
5	000002	万 科 A	199,872.72	3.83
6	000001	平安银行	162,224.78	3.11
7	300750	宁德时代	146,699.67	2.81
8	000725	京东方 A	142,611.28	2.74
9	300498	温氏股份	141,756.48	2.72
10	002415	海康威视	132,028.10	2.53
11	300760	迈瑞医疗	123,815.68	2.38
12	000063	中兴通讯	121,921.10	2.34
13	300059	东方财富	121,738.68	2.34
14	002714	牧原股份	95,905.76	1.84
15	000100	TCL 科技	90,375.76	1.73
16	002142	宁波银行	87,755.96	1.68
17	000338	潍柴动力	82,357.52	1.58
18	000568	泸州老窖	77,962.76	1.50
19	300015	爱尔眼科	76,499.71	1.47
20	002027	分众传媒	73,617.88	1.41

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	4,381,074.28
卖出股票收入（成交）总额	5,884,759.19

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的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本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	1,246.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	72.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,319.38

### 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	87	14,904.72	4,000.00	0.31%	1,292,711.00	99.69%
诺德 300B	215	6,031.21	-	-	1,296,711.00	100.00%
诺德 S300	751	3,125.12	882.00	0.04%	2,346,085.57	99.96%
合计	1,053	4,691.73	4,882.00	0.10%	4,935,507.57	99.90%

### 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	蔡小婉	711,586.00	54.88%
2	夏永清	160,000.00	12.34%
3	何兆睿	79,602.00	6.14%
4	吴捷云	70,416.00	5.43%
5	毛建宇	49,300.00	3.80%
6	李君	46,200.00	3.56%
7	唐梦雪	43,625.00	3.36%
8	朱艳春	13,017.00	1.00%
9	罗园	10,000.00	0.77%
10	罗建迪	9,681.00	0.75%

诺德 300B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	张金玲	151,154.00	11.66%
2	王雷	73,834.00	5.69%
3	肖焕文	50,600.00	3.90%
4	沈卫萍	48,200.00	3.72%
5	吉凯	45,028.00	3.47%
6	杨丽	40,825.00	3.15%
7	冯景阳	39,600.00	3.05%
8	甘遵义	37,534.00	2.89%
9	孔明	35,948.00	2.77%
10	杨景余	30,000.00	2.31%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺德 300A	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	1,497,586.00	1,497,586.00	3,089,820.70
本报告期基金总申购份额	-	-	7,532,588.35
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	8,677,191.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-200,875.00	-200,875.00	401,750.00
本报告期末基金份额总额	1,296,711.00	1,296,711.00	2,346,967.57

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，本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，于 2020 年 6 月 22 日表决通过《关于终止诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

### 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) 本报告期内，基金管理人无重大人事变动。  
(2) 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 2020 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）为本基金提供过 8 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	
国泰君安	1	9,437,350.44	91.96%	8,788.94	91.96%	-
民生证券	1	825,251.75	8.04%	768.63	8.04%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-

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：华金证券股份有限公司，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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

### 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	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、指定互联网网站	2020 年 1 月 6 日
2	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2020 年 1 月 20 日
3	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 1 月 20 日
4	诺德基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整旗下基金相关业务安排的提示性公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 1 月 31 日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在江苏汇林保大基金销售有限公司开通申购、赎回、转换以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 2 月 20 日
6	诺德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 3 月 14 日
7	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 3 月 18 日
8	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 3 月 20 日
9	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 3 月 24 日
10	诺德基金管理有限公司关于诺德	上海证券报、指定互	2020 年 3 月 25 日

	深证 300 指数分级证券投资基金暂停跨系统转托管业务的公告	联网网站	
11	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 3 月 25 日
12	诺德基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 3 月 24 日
13	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金在华瑞保险销售有限公司开通申购、赎回、转换以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2020 年 3 月 31 日
14	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 3 月 31 日
15	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 3 日
16	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 7 日
17	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 13 日
18	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 4 月 13 日
19	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 15 日
20	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	指定互联网网站	2020 年 4 月 15 日
21	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 4 月 15 日
22	诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300B 份额风险提示公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 16 日
23	诺德深证 300 指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2020 年 4 月 22 日
24	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网址	2020 年 4 月 22 日



25	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金暂停参加中信证券华南股份有限公司(原广州证券)申购费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网址	2020年4月28日
26	诺德深证300指数分级证券投资基金调整大额申购限额的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年4月30日
27	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华安证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2020年5月7日
28	诺德深证300指数分级证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年5月15日
29	诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年5月19日
30	诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年5月20日
31	诺德基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年5月21日
32	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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年6月22日
33	关于诺德深证300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年6月22日
34	关于诺德深证300指数分级证券投资基金终止办理申购、赎回、定期定额投资、配对转换及转托管业务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年6月29日
35	关于诺德深证300指数分级证券投资基金之诺德深证300A份额、诺德深证300B份额终止上市的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020年6月29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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200513-20200601	-	5,902,007.00	5,902,007.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2020 年 6 月 23 日披露了《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金份额持有人大会已于 2020 年 6 月 22 日表决通过《关于终止诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

2、本基金管理人于 2020 年 6 月 29 日披露了《关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金终止办理申购、赎回、定期定额投资、配对转换及转托管业务的公告》，本基金自 2020 年 7 月 2 日起进入清算程序，本基金管理人自该日起终止办理本基金的申购、赎回、定期定额投资、配对转换及转托管业务。

3、本基金管理人于 2020 年 6 月 29 日披露了《关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金之诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额终止上市的公告》，本基金之诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额于 2020 年 7 月 2 日终止上市。

## § 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 2020 年中期报告原文。

### 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

2020 年 8 月 28 日