

基金管理人:诺德基金管理有限公司  
报告期末:2012年12月31日  
日期:2013年3月29日

1 重要提示及目录

**1.1重要提示**  
基金管理人的董事会、监事会对本报告无虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
本报告经本基金托管人根据本基金合同规定，于2013年3月28日复核。报告期间的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据，保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

除特别说明外，本报告所有财务数据均按人民币折算，除非特别说明，本报告所指的“基金”即为“诺德深证300指数分级证券投资基金管理有限公司管理的诺德深证300指数分级证券投资基金”，即“本基金”。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 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:诺德深证300  
基金主代码:363506  
基金运作方式:契约型开放式  
上市交易场所:深圳证券交易所  
成立日期:2012年9月10日  
报告期末基金资产净值:409,869,413.86元  
报告期末基金份额总额:10,000,000份  
报告期净值增长率:4.50%  
报告期净值增长率标准差:3.78%

报告期期间基金资产配置:股票89.94%，现金类资产10.06%

报告期期间投资收益分配情况:无

报告期期间费用计提情况:无

报告期期间向基金份额持有人进行分配的情况:无

报告期期间基金发生的持续关联交易:无

报告期期间基金投资策略:无

报告期期间基金估值政策:无

报告期期间基金业绩评价:无

报告期期间基金风险收益特征:无

报告期期间基金资产支持证券投资情况:无

报告期期间基金投资组合变动情况:无

报告期期间基金投资策略调整情况:无

报告期期间基金投资策略调整原因:无

报告期期间基金投资策略调整结果:无

报告期期间基金投资策略调整影响:无

报告期期间基金投资策略调整影响: