

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
报告送达日期：二〇一三年八月二十七日

重要提示及目录

1.1 重要提示
基金托管人的董事声明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。本年度报告经三分之二以上独立董事董事签字同意，报中国证监会备案。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同约定，于2013年8月26日核对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，确认复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本年度报告摘要摘录了半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

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

报告期基金份额总额：52,982,635.28份

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

下属分级基金的交易代码：150092 150093 165707

报告期末下属分级基金的份额总额：532689.00份 532689.00份 519275.28份

2.2 基金产品说明

本基金运用完全复制法为指标的指数化投资方法，通过严格的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差控制在0.5%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对深证300指数的低成本有效跟踪，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长。

本基金为被动型指数基金，采用完全复制指数的投资方法，通过成份股在深交所300指数中的收益表现，并根据标的指数成份股的权重进行相应地调整。

当预期成份股发生调整或新增时，基金管理人将及时调整，增发、分红等行为，以及因基金的申购赎回或跟踪误差跟踪深证300指数的效果将带来影响，导致无法复制指数的跟踪误差。基金管理人将根据实际情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当地调整，以力争跟踪误差控制在预定的范围之内。

本基金为被动型指数基金，适合长期持有，不适合频繁交易。

本基金的申购赎回费用率为0.98%，基金份额总额52,982,635.28份。

2.3 基金风险收益特征

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份额具有高风险、高预期收益的特征；诺德深证300B份额具有低风险、收益相对稳定的特征。

诺德S300份额具有低风险、收益相对稳定的特征。

2.4 信息披露方式

登载半年度报告摘要的管理人互联网网址：www.mofund.com

基金半年度报告备置地点：基金管理人和基金托管人的住所。

2.5 其他重要资料

3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期实现收益 5,000,738.97

本期利润 -2,443,561.79

本期每份份额净值增长率 -0.47%

本期每份份额净值增长率 -0.36%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

本期末基金资产净值 -0.0043

本期末基金资产净值 52,316,155.72

期末基金份额净值 0.987

注：1. 本基金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，采用期末未资产负债表中已实现部分的孰低值（为期末利润减去本期利润）。

3. 本期每份份额净值增长率，表示自基金成立以来至报告期末的年平均收益率。

4. 期末可供分配基金份额总额，即期末可供分配利润减去本报告期利润。

5. 本基金深证300指数分级证券投资基金深证300A、深证300B、深证S300三类基金份额的深证300指数净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

6.3.2 基金深证300A份额每份基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

深证深证300A指数分级证券投资基金深证300A指数净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2 股权投资期末按行业分类的股票投资组合

7.2.3 债券投资期末按行业分类的债券投资组合

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.32 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.33 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.34 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.35 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.36 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.37 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.38 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.39 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.40 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.41 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.42 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.43 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.44 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.45 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.46 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.47 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.48 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.49 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.50 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.51 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.52 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.53 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.54 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.55 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.56 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.57 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.58 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.59 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.60 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.61 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.62 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.63 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.64 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.65 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.66 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.67 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.68 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.69 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.70 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.71 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.72 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.73 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.74 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.75 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.76 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.77 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.78 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

7.3.79 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细