

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
报告送出日期:二〇一四年四月二十二日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及高级管理人员保证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责任。

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2014年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺德深证300指数分级证券投资基金
基金代码:168797
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年7月10日
报告期末基金资产净值:3,076,661.58元

投资目标:本基金通过以现金流复利为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数据化风险控制手段，力争在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，以实现对所配置300只股票的有选择的、分层的跟踪管理，构建长期的资产组合，实现基金资产的保值增值。

投资策略:本基金通过定期复利的方式，按所持有的股票在300只股票中，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对所配置300只股票的有选择的、分层的跟踪管理，构建长期的资产组合，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准:本基金通过定期复利的方式，力争在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，以实现对所配置300只股票的有选择的、分层的跟踪管理，构建长期的资产组合，实现基金资产的保值增值。

风险收益特征:本基金为股票型基金，风险收益特征高于股票型基金，风险收益特征低于股票型基金。

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

下属二级基金的基金简称:诺德300A 诺德300B 诺德300C

下属二级基金的交易代码:168692 150093 168570

报告期末下属二级基金:810,337份 810,337份 82,576,661.58份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年1月1日至2014年3月31日)

1.本期已实现收益 -147,026.31

2.本期利润 -3,381,477.24

3.期间平均基金份额本期利润 0.0604

4.期末基金资产净值 52,190,757.59

5.期末基金份额净值 0.974

注:上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。

2.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,本期利润本期已实现收益加上本期公允价值变动收益)

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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

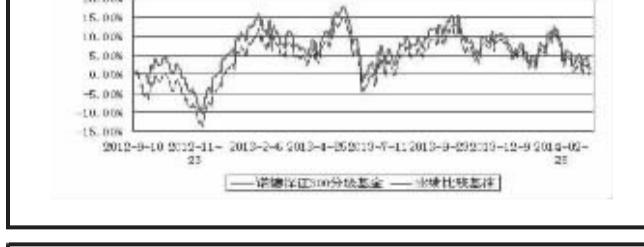
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2014年1月1日至2014年3月31日 -6.93% 1.33% 1.60% 0.11% 2.81% 0.21% 0.04%

3.2.2 基金合同生效以来基金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

该报告期深证300指数分级证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势对比图(2012年9月10日至2014年3月31日)



注:该报告期深证300指数分级证券投资基金

5.2.1 基金投资按行业分类的股票投资组合

5.2.1.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.2 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

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.3 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

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.4 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

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.7 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.8 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.9 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.12 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.13 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.14 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.17 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.18 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.19 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.22 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.23 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.24 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.27 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.28 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.29 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.32 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.33 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.34 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.35 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.36 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.37 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.38 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.39 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.40 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.41 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.42 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.43 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.44 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.45 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.46 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.47 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.48 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.49 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组合

本基金报告期末未持有权证。

5.2.1.50 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.2.1.51 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.2.1.52 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组合

本基金报告期末未持有债券。

5.2.1.53 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组合

本基金报告期末未持有贵金属。

5.2.1.54 期末按公允价值占基金资产