

诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告期截止日期:2013年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。投资人投资有风险，投资人应在作出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称:诺安上证新兴产业ETF联接
交易代码:320004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年4月7日
报告期末基金份额总额:657,336,805.77份

投资目标:通过将绝大部分基金财产投资于上证新兴产业ETF，密切跟踪行业基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为上证新兴产业ETF的联接基金，主要通过投资于上证新兴产业ETF来实现对股票型基金的投资。

本基金在报告期内存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所涉及的关联交易公平对等，不存在不公平对待不同客户、利益输送等违法违规行为。

投资策略:本基金在报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所涉及的关联交易公平对等，不存在不公平对待不同客户、利益输送等违法违规行为。

业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

风险收益特征:本基金为契约型开放式基金，债券基金与货币市场基金同属低风险品种。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数所指的指数、即标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

目标基金的投资目标:本基金的标的指数是上证新兴产业指数。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

本基金主要采用完全复制的指数的表示法，即按照标的指数的构成股票的权重及其所构建的基金投资组合，并根据标的指数成份股的权重其重大的变动进行相应调整，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

目标基金投资策略:本基金是股票基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，本基金为指数型基金，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

目标基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率。

目标基金风险收益特征:本基金为股票基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，本基金为指数型基金，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

注:本基金上市交易的证券交易所为“上海证券交易所”，基金的二级市场价格简称“新兴ETF”，基金的申购、赎回简称“新兴申赎”，申购、赎回代码为“510261”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -5,431,072.71

2.本期利润 12,129,896.76

3.期初平均基金份额利润 0.0180

4.期末基金份额净值 442,499.092.88

5.期末基金份额净值 0.673

注:上述基金业绩指标不包括持有人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，本期利润为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 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×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

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.3 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.4 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

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.5 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.6 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.7 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.8 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.9 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.10 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.11 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.12 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.13 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.14 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.15 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.16 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.17 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.18 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.19 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.20 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.21 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.22 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%

注:本基金业绩比较基准:上证新兴产业指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

3.2.23 本期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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率差④

过去三个月 3.06% 1.30% 1.35% -0.23% -0.05%