

## 诺安中证100指数证券投资基金

## [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  
报告送出日期:2013年1月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会、监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內容，保证复核的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。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

本报告期基金净值增长率为11.68%，同期业绩比较基准收益率为11.96%，跟踪误差为0.28%，实现较好的跟踪效果。

## § 2 基金产品概况

基金简称 诺安中证100指数  
交易代码 320010  
基金运作方式 约定开放式  
基金合同生效日 2009年10月27日  
报告期末基金份额总额 1,395,006,984.14份

本基金完全复制中证100指数，力求跟踪误差最小化。2012年第四季度本基金净值大幅度回升，2012年度本基金净值收益率超过11%，为基金份额持有人创造了比较满意的投資回报。

从2012年12月的PMI数据来看，2013年第一季度中国经济仍然是缓弱回升态势。由于新一届政府积极推进“新型城镇化”战略，因此新的一年积极财政政策值得期待。为配合积极财政政策，估计2013年度货币政策略有宽松，尤其值得关注的是，2013年强化金融监管，规范“影子银行”，有利于降低社会融资成本。因此中小企业融资在2013年将得到改善，这些都会利好股市。

从2012年全国金融工作会议来看，2013年最后一刻“悬崖勒马”，避免落入“财政悬崖”。欧美等发达国家2013年开局“大派”，但是2013年欧洲国家财政紧缩是大势所趋，美国在2013财年年度减赤政赤字达1,000亿美元。美联储2013年度量化宽松政策不及2012年。从这个角度来看，欧美股市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。

根据国际大宗商品价格来看，2013年上半年回暖大概率事件。全球经济关注的焦点在于新兴市场，中国A股市场是首当其冲。

综合国内外形势分析，2013年第一季度仍是投资股市比较适宜的时间窗口。低估值蓝筹板块仍然有比较好的投资机会，中证100指数在2013年第一季度仍然值得期待。本基金继续复制中证100指数，继续分享蓝筹板块上涨的投资机会。

## § 3 报告期内基金业绩表现

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 -23,508,872.47

2.本期利润 112,917,935.26

3.加权平均基金份额本期利润 0.0754

4.期末基金资产净值 1,027,270,786.21

5.期末基金份额净值 0.736

注:①本基金业绩比较基准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 基金报告期份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率变动的比较

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

过去三个月 11.68% 1.21% 11.96% 1.20% -0.28% 0.01%

注:本基金业绩比较基准:中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%。

3.2.1 自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

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

过去三个月 11.68% 1.21% 11.96% 1.20% -0.28% 0.01%

注:本基金业绩比较基准:中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自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

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

过去三个月 11.68% 1.21% 11.96% 1.20% -0.28% 0.01%

注:本基金业绩比较基准:中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%。

3.3 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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -23,508,872.47

2.本期利润 112,917,935.26

3.加权平均基金份额本期利润 0.0754

4.期末基金资产净值 1,027,270,786.21

5.期末基金份额净值 0.736

注:①本基金业绩比较基准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。

## 3.4 基金的业绩表现

3.4.1 本报告期内本基金的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了公平交易制度。制度包括境内上市股票、债券的一级市场场内、二级市场场外等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、绩效评估等投资管理活动相关的各个部分。

投资研究方面，公司独立成立所有投资组合适用的证券投资备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的股权投资制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理对投资范围的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理制度，所有外部研究报告均通过研究管理平台发布，并确保该平台对所有研究报告进行公开透明的管理。

执行方面，对于执行买入、卖出指令，基金经理在投资交易系统中设置公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行；基金经理将买卖指令按比例拆分到各投资组合；对于债券一级市场场外，非公开发行股票购销等非集中竞价交易的，基金经理将申购金额均匀分配，并将申购指令下达到各投资组合；在申购之前，所有投资组合的申购金额和数量经公平性校验后，将申购指令下达到各投资组合；对于银行间同业市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易、投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令、交易中心向交易所反馈时，确认成交，并根据时间优先、价格优先”的原则执行。

投资研究方面，公司独立成立所有投资组合适用的证券投资备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的股权投资制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理对投资范围的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理制度，所有外部研究报告均通过研究管理平台发布，并确保该平台对所有研究报告进行公开透明的管理。

执行方面，对于执行买入、卖出指令，基金经理在投资交易系统中设置公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行；基金经理将买卖指令按比例拆分到各投资组合；对于债券一级市场场外，非公开发行股票购销等非集中竞价交易的，基金经理将申购金额均匀分配，并将申购指令下达到各投资组合；在申购之前，所有投资组合的申购金额和数量经公平性校验后，将申购指令下达到各投资组合；对于银行