

## 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。  
本报告自2012年10月11日起至12月31日止。

## §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	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月27日
报告期末基金份额总额	1,395,006,981.48份
投资目标	本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险控制策略,力求实现指数投资精度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的权重和流动性状况,力争实现指数投资精度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
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%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,可获取资本市场平均收益,其风险和预期收益高于债券型基金和货币型基金。
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

## §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	-23,508,872.47
2.加权平均基金份额本期利润	112,917.93526
3.加权平均基金份额本期利润	0.00754
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	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



## §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
梅律昔	基金经理	2012年7月28日	15	硕士,具有基金从业资格。曾任职于德意志资产管理(中国)有限公司,2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监。梅律昔于2007年11月起担任诺安中证100指数证券投资基金基金经理,2012年7月28日起任诺安中证100指数证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日;  
②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内基金运作的遵规守信情况说明  
报告期间,诺安中证100指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明  
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《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括场内交易、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的所有环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,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;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的投资管理平台,所有对外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究和投资组合开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的交易指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统会自动将证券的每笔交易金额自动按比例分配到各个组合;对于债券一级市场申购,非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、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,交易中心向银行间市场或交易所对手询价、交易确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本基金在本报告期内不存在异常交易行为。未发生违反基金管理人管理的所有投资组合参与的交易中公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,是由于公司旗下个别基金使用成交较少的单边交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
进入2012年第四季度,中国经济开始企稳并缓慢回升。中国制造业PMI、发电量、铁路货运量以及水泥价格等指标均呈现逐月回升态势,企业利润在2012年第四季度终止了下行趋势,并且逐渐企稳。从宏观基本面来看,A股市场底部回升创造了条件。

2012年10月份共有18大胜利利好,新一届高层上任以后,上行趋势已经得到乐观预期。市场信心得以经济刺激和“稳增长”政策以及改善民生态度,都是恢复A股市场投资者信心的关键所在。

2012年12月初创业板市场创出年内新低之后,强势回升,银行等低估值蓝筹板领涨市场,第四季度A股市场成为全球表现最好的股市,上证指数在A股市场表现最好,2012年第四季度涨幅超过15%,其次是中证100指数,2012年第四季度涨幅超过12%。

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超过11%,为基金持有人创造了比较满意的投资回报。

从2012年12月PMI数据来看,2013年第一季度中国经济仍将继续回升态势。由于新一届政府积极推行“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年度货币政策将宽松,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A股市场。

从2013年全球资产配置格局来看,美国在2012年最后一刻“悬崖勒马”,避免落入“财政悬崖”,欧美等外围市场2013年开局大亮,但是2013年欧美国家财政紧缩是大势所趋。美国在2013财年年度削减财政赤字2000亿美元,美联储2013年度量化宽松力度可能不及2012年度。从这个角度来看,欧美股市、债市以及大宗商品价格在2013年上半年回调概率大,全球资本关注的焦点在新兴市场,中国A股市场是首选。

综合国内与国际形势,2013年第一季度仍然是投资A股市场比较适宜的时间窗口。低估值蓝筹板块仍有比较良好的投资机会。中证100指数在2013年第一季度仍值得期待。本基金继续复制中证100指数,继续分享蓝筹板块上涨带来的投资机会。

4.2 报告期末基金的业绩表现  
截至报告期末,本基金份额净值为0.736元。本报告期基金份额净值增长率为11.68%,同期业绩比较基准收益率为11.96%,跟踪误差为0.28%;实现了较好的跟踪效果。

## §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	974,604,060.12	94.29
	其中:股票	974,604,060.12	94.29
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	58,133,973.41	5.62
6	其他资产	917,874.40	0.09
7	合计	1,033,655,907.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末股票投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	1,971,959.68	0.19
B	采掘业	104,330,033.99	10.16
C	制造业	236,667,910.01	23.04
D	消费品、饮料	67,058,350.94	6.53
E	纺织、服装、皮毛	-	-
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	石油、化学、塑胶、塑料	4,835,523.31	0.47
I	电子	3,931,836.16	0.35
J	金属、非金属	57,704,445.80	5.62
K	机械、设备、仪表	93,201,236.00	9.07
L	医药、生物制品	9,806,878.50	0.95
M	其他制造业	469,637.30	0.05
N	电力、煤气及水的生产和供应业	25,755,895.14	2.51
O	建筑业	33,602,266.66	3.27
P	交通运输、仓储业	27,793,071.96	2.71
Q	信息技术业	13,988,100.00	1.36
H	批发和零售贸易	8,443,285.55	0.82
I	金融、保险业	459,605,928.17	44.74
J	房地产业	54,837,938.46	5.34
K	社会服务业	7,607,580.00	0.74
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	974,604,060.12	94.87

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3.1 报告期末股票投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	6,450,746	50,702,863.56	4.94
2	600036	招商银行	3,528,849	48,521,673.57	4.72
3	601318	中国平安	962,600	43,586,154.00	4.26
4	601166	兴业银行	2,157,817	33,013,965.73	3.51
5	601328	交通银行	6,706,339	33,129,316.66	3.22
6	600000	浦发银行	3,183,439	31,579,714.88	3.07
7	601939	建设银行	6,705,219	30,844,007.80	3.00
8	000002	万科A	2,804,216	28,378,665.92	2.76
9	600030	中信证券	1,978,236	26,429,232.96	2.57
10	600519	贵州茅台	114,789	23,993,196.78	2.34

5.3.2 报告期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注  
5.8.1 本基金本报告投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现被报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金本报告投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,978.79
4	应收利息	155,895.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	917,874.40

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位:份	本报告期初基金份额总额	本报告期基金份额总额
	1,575,413,872.36	1,395,006,981.48

本报告期初基金份额总额:1,575,413,872.36  
本报告期基金份额总额:1,395,006,981.48

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

本报告期基金份额变动情况:减少1,178,406,890.88份

## 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

## 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