

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
送出日期:2013年3月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月22日复核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,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及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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
基金主代码	320014
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
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
报告期末基金份额总额	657,336,805.77份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月7日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年6月8日
基金管理人名称	诺安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	657,336,805.77份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 基金产品说明

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,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪误差最小化。
投资策略	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以达到投资目标。当本基金的申购赎回和在二级市场买卖上证新兴产业ETF或其基金自身的申购赎回对基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生拆股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
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	本基金为上证新兴产业ETF的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票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。
2.2.1 目标基金产品说明	本基金在本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金经理管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,均是由于旗下个别基金使用量化投资策略所致。

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,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数的表现,并根据标的指数成份股的权重调整其重仓股的变动比例,并根据标的指数成份股的权重调整其重仓股的变动比例,并根据标的指数成份股及备选成份股的比例不高于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,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。

2.2.2 基金产品说明

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,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数的表现,并根据标的指数成份股的权重调整其重仓股的变动比例,并根据标的指数成份股及备选成份股的比例不高于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证新兴产业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	陈勇	赵会军
信息披露负责人	0755-83026688	010-66105799
联系电话	0755-83026688	010-66105799
电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95588
传真	0755-83026677	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2012年	2011年4月7日-基金合同生效日)-	2011年12月31日
本期已实现收益	-16,033,672.46	-110,318,615.03	
本期利润	-22,076,383.05	-218,616,902.34	
加权平均基金份额本期利润	-0.0322	-0.2635	
本期基金份额净值增长率	-3.17%	-30.50%	

3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供基金份额利润	-0.3268	-0.3048
期末基金份额净值	442,499,092.88	464,851,357.96

期末基金份额净值	0.673	0.695
注:①上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计算上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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率为①	份额净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	①-③	②-④
过去三个月	3.06%	1.30%	3.29%	1.35%	-0.23%	-0.05%
过去六个月	-6.01%	1.31%	-6.54%	1.37%	0.33%	-0.06%
过去一年	-3.17%	1.40%	-3.31%	1.47%	0.14%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-32.70%	1.31%	-37.14%	1.46%	4.44%	-0.15%

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

注:本基金合同生效于2011年4月7日,建仓期结束时各项资产配置的比例符合合同规定。截至2012年12月31日止,本基金建仓期结束未满1年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2011年4月7日生效,2011年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2011年4月7日生效,截至2012年12月31日,本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

截至2012年12月,本基金管理人共管理24只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安双债债券型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安环球黄金配置基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安深证成份指数证券投资基金、诺安动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安策略指数证券投资基金、诺安沪深300保本基金、诺安双利债券型开放式指数证券投资基金及诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期限 说明

宋德舜 上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理及联接基金基金经理 6 2011年4月7日

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日起。

②基金经理的报告期内从业资格情况符合《证券投资基金从业人员执业行为规范》的相关规定等。

③管理人对报告期内从业人员遵纪守法情况的说明

报告期内,诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理严格遵守了中华人民共和国证券投资基金法及其有关规定,遵守了《诺安上证新兴产业交易型开放式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。

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年1月23日

[2012]年度报告摘要

4.3 管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会《公开募集证券投资基金公平交易制度指导意见(试行)》,本公司更新并完善《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动,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相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立公司所有投资组合适用的证券估值库,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;公司拥有的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界定,投资组合经理独立于基金经理,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;公司建立了统一的研究管理平台,所有内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员和投资组合经理开放。

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点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券组合将该笔交易拆分到各投资组合,对于债券一级市场申购、非公开发行股票等大宗交易,将交易金额按照各投资组合的申购金额比例分配,对于债券二级市场交易,将交易金额按照各投资组合的申购金额比例分配,对于债券一级市场申购等