

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

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制本报告过程中,力求做到内容真实、准确、完整,但不保证基金收益,也不保证基金本金安全。基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制本报告过程中,力求做到内容真实、准确、完整,但不保证基金收益,也不保证基金本金安全。基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制本报告过程中,力求做到内容真实、准确、完整,但不保证基金收益,也不保证基金本金安全。

诺安中证100指数证券投资基金

2012 年 度 报 告 摘 要

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:
奥成文 薛有为 薛有为
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注
7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。
7.4.2 差错更正的说明
本基金本报告期无差错更正。
7.4.3 关联方关系

项目	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记机构、销售机构
中国工商银行股份有限公司	托管人
中国中化股份有限公司	管理人股东母公司
中国中化集团公司	管理人股东最终控制方

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。
7.4.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.1.1 股票交易
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。
7.4.1.2 权证交易
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。
7.4.1.3 应支付关联方的佣金
本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。
7.4.2 关联方报酬
7.4.2.1 基金管理费

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,997,206.38	9,971,999.23
其中:支付销售机构的客户维护费	1,160,583.11	1,534,632.86

注:A.基金管理费按前一日的前基金资产净值的0.75%的年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.75%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的前基金资产净值
B.基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
7.4.2.2 基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,799,441.28	1,994,399.88

注:A.基金托管费按前一日的前基金资产净值的0.15%的年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.15%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的前基金资产净值
B.基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付。
7.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。
7.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期及上年度除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。
7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
中国工商银行股份有限公司	58,094,487.13	69,988,402.53

7.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金在承销期间无参与关联方承销证券的情况。
7.4.4.7 其他关联方事项的说明
本基金无其他关联方事项。
7.4.5 期末 2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发证券而流通受限证券。
7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌期间	期初估值金额	停牌日期	复牌开盘日期	数量(股)	期末成本总额	期末市值总额	备注
000002	万科A	2012年12月26日	重大事项	10.12	2013年1月21日	11.13	2,804,216	25,311,272.58	28,378,665.92	-
000527	华发股份	2012年8月27日	重大事项	9.18	-	-	708,540	9,907,250.83	6,504,397.20	-
601618	中国中冶	2012年12月26日	重大事项	2.26	2013年1月4日	2.33	1,393,472	4,902,835.37	3,149,246.72	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2012年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无债券作为质押。
7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2012年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,该笔交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
银行存款	58,094,487.13	69,988,402.53
结算备付金	39,486.28	548,252.18
存出保证金	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	974,604,060.12	1,012,131,302.87
其中:股票投资	974,604,060.12	1,011,181,632.47
基金投资	-	-
债券投资	-	949,670.40
资产支持证券投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收货币资金	-	-
应收利息	11,978.79	10,118.56
应收股利	-	-
应收申购款	155,895.61	66,686.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,033,655,907.93	1,083,494,762.80

负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	5,005,728.59	109,945.23
应付管理人报酬	623,438.19	707,976.24
应付托管费	126,287.63	141,595.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	156,494.17	324,798.25
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	465,173.14	350,209.05
负债合计	6,385,127.72	1,634,524.01
所有者权益:	-	-
实收基金	1,395,006,981.48	1,639,350,854.53
未分配利润	-367,736,195.27	-557,490,615.74
所有者权益合计	1,027,270,786.21	1,081,860,238.79
负债和所有者权益总计	1,033,655,907.93	1,083,494,762.80

注:报告期末2012年12月31日,基金资产净值0.736元,基金份额总额1,395,006,981.48份。
7.2 利润分配
会计主体:诺安中证100指数证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

资产	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	131,446,558.01	-232,761,269.64
1.利息收入	623,397.55	1,418,448.52
其中:存款利息收入	594,800.63	583,148.25
债券利息收入	1,796.91	8,646.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	26,800.01	826,653.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-131,957,632.26	-101,183,039.33
其中:股票投资收益	-158,885,052.01	-119,908,549.09
基金投资收益	-	-
债券投资收益	109,331.60	390,088.38
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	26,818,088.15	18,335,421.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	261,775,064.38	-133,799,299.38
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,005,728.34	802,620.55
二、费用	14,542,898.84	14,767,405.96
1.管理人报酬	8,997,206.38	9,971,999.23
2.托管费	1,799,441.28	1,994,399.88
3.销售服务费	-	-
4.利息支出	3,327,795.68	2,381,749.85
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	418,455.50	419,257.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	116,903,659.17	-247,528,675.60
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	116,903,659.17	-247,528,675.60

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:诺安中证100指数证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,639,350,854.53	-557,490,615.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,903,659.17
三、本期基金净值变动数(本期利润)	-244,343,873.05	72,850,761.30
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
五、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动数(扣除赎回费)	-	-
六、其他	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细				金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	136,025,609.60	12.57
2	600036	招商银行	58,065,129.47	5.37
3	600000	浦发银行	38,611,663.19	3.57
4	600016	民生银行	32,474,729.50	3.00
5	601939	建设银行	29,125,618.45	2.69
6	601328	交通银行	27,334,821.59	2.53
7	601288	农业银行	23,427,811.00	2.17
8	601166	兴业银行	23,304,613.11	2.15
9	600519	贵州茅台	21,408,284.70	1.98
10	601088	中国神华	18,907,380.17	1.75
11	600030	中信证券	17,440,460.72	1.61
12	000058	五粮液	16,809,953.67	1.55
13	600837	海通证券	16,756,358.02	1.55
14	601818	光大银行	16,315,596.00	1.51
15	000012	万科A	16,122,590.17	1.49
16	601601	中国太保	13,929,355.33	1.29
17	002304	洋河股份	11,755,504.16	1.09
18	600015	华夏银行	11,634,648.71	1.08
19	600048	保利地产	11,423,251.17	1.06
20	000937	冀中能源	11,143,998.25	1.03