

# 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

## 【2015】年度报告摘要

本基金于本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公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量并不超过当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析  
报告期内,本基金的市场化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在基金合同约定的范围之内。报告期内,本基金跟踪误差主要来自指数成份股停牌,原因是在较大的最小申赎单位下,申购赎回清单中各股票权重与标的指数权重产生了一定差异。本基金管理人在量化分析基础上,借助适当的组合优化模型,尽可能地控制跟踪误差与偏离度。

截至报告期末,本基金份额净值为1.269元,本报告期基金份额净值增长率为23.44%,同期业绩比较基准收益率为27.18%。

展望未来,从基本面角度,不要轻看多小盘行情;从基本面角度,业绩的持续性保证了本基金仓位适度调整的可能性很小,但这并不意味着没有大的波动。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明  
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会证券基金估值委员会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务和份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同约定的,日常估值由本基金管理人及本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和本年度估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、合规与风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导估值业务。估值小组成员均由公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值程序由估值小组制定,并由估值小组负责估值,估值小组定期召开估值会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有表决权及有效议案权等一票表决权,从而将估值调整程序进行适当限制,保证基金估值的公平、合理、保持估值公允性的一致性。

报告期内,本基金未发生与估值相关的定价问题。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明  
符合有关基金分红条件的情况下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%;若《基金合同》生效不满3个月不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有的人数或基金份额持有人数量不满二百人或者基金份额净值低于五千万元的情况。  
本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金份额净值低于五千万元的情况。

5 托管人报告  
5.1 报告期内,本基金托管人遵照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金托管业务实施细则(试行)》、《证券投资基金托管业务操作指引》等法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
报告期内,诺安上证新兴产业ETF证券投资基金联接基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安上证新兴产业ETF证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安上证新兴产业ETF证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见  
本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安上证新兴产业ETF证券投资基金联接基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告  
德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师王明静、吴昊于2016年3月25日出具了德勤华永(沪)信审字[2016]第0685号“无保留意见的审计报告”。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债情况  
截至2015年12月31日,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  
单位:人民币元

资产	本报告期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
银行存款	6,719,043.92	34,072,461.62
结算备付金	-	-
存出保证金	30,124.69	31,579.10
交易性金融资产	81,319,571.76	226,402,000.00
其中:股票投资	5,223,571.76	-
基金投资	76,096,000.00	226,402,000.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
其他金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收利息	-	-
应收股利	1,470.89	4,692.81
其他应收款	3,688.10	4,274.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	88,073,897.57	249,606,006.89

负债和所有者权益	本报告期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
应付短期融资券	-	-
应付账款	42,022.79	4,028,113.29
应付赎回款	6,617.54	9,322.81
应付托管费	1,120.51	1,966.48
应付销售服务费	-	-
应付利息	11,312.26	96,182.77
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债合计	120,149.81	120,276.53
所有者权益:		
实收基金	69,246,073.63	238,711,509.32
未分配利润	18,648,624.34	6,637,726.59
所有者权益合计	87,893,697.97	246,349,234.91
负债和所有者权益总计	88,073,897.57	249,606,006.89

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.269元,基金份额总额69,246,073.63份。

7.2 利润表  
会计主体: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  
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日  
单位:人民币元

资产	本报告期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	73,573,216.91	83,973,756.42
1.利息收入	108,670.68	179,394.75
其中:存款利息收入	108,670.68	179,394.75
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	97,636,891.80	18,013,867.15
其中:股票投资收益	-907,484.92	-736,226.29
基金投资收益	98,494,488.77	18,749,103.44
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资损益	-	-
衍生工具收益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-24,318,708.44	65,687,502.67
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)	16,382.89	12,568.86
减:二、费用	856,437.38	986,715.63
1.管理人报酬	90,187.36	115,294.29
2.托管费	18,027.41	23,668.80
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	564,041.59	493,286.91
5.利息支出	-	-
其中:应付短期融资券支出	-	-
6.其他费用	362,071.00	354,103.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	72,737,779.56	82,988,040.39
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净收益以“-”号填列)	72,737,779.56	82,988,040.39

7.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体: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  
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日  
单位:人民币元

项目	本报告期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	238,711,509.32	6,637,726.59
二、本期增减变动金额	6,637,726.59	246,349,234.91
1.本期新增基金份额的基金净值变动(本期申购)	-	72,737,779.56
2.本期赎回基金份额的基金净值变动(赎回)	-	-
3.本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购赎回费、销售服务费减少以“-”号填列)	-109,466,473.69	-60,726,880.51
其中:1.基金申购费	84,164,796.18	44,702,541.17
2.基金赎回费	-263,631,238.87	-106,429,421.96
三、本期基金份额持有人认购、申购、赎回、转换及转入、转出基金产生的基金净值变动(扣除基金管理人报酬、托管费、销售服务费、交易费用、利息支出、其他费用、利息收入、公允价值变动收益、其他收入、其他费用)	-	-369,060,648.85
四、本期所有者权益(基金净值)变动额	69,246,073.63	18,648,624.34
五、期末所有者权益(基金净值)	307,957,582.95	265,386,351.33

8.1 期末基金资产组合情况  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600312	平安银行	26,400	914,800.00	0.95
2	601959	吉视传媒	63,700	393,660.00	0.40
3	600089	特变电工	33,100	389,587.00	0.44
4	600084	上海钢联	14,000	332,080.00	0.38
5	601727	上海电气	17,100	197,230.00	0.22
6	600104	上汽集团	8,800	188,730.00	0.21
7	600039	万华化学	9,800	174,630.00	0.20
8	600276	恒顺醋业	3,000	147,300.00	0.17
9	600180	东方明珠	7,700	133,210.00	0.16
10	600372	中恒电气	5,600	138,465.00	0.15

注:投资组合中未计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	601796	中国中车	2,238,263.00	0.91
2	601599	中航证券	1,792,322.00	0.73
3	600276	恒顺醋业	1,251,626.00	0.51
4	601727	上海电气	1,212,099.00	0.49
5	600619	康华药业	1,162,192.00	0.47
6	600007	中国国贸	1,156,567.00	0.47
7	601106	中国一重	1,126,712.22	0.46
8	600703	三安光电	1,091,423.91	0.44
9	600076	东方明珠	1,072,776.06	0.44
10	600066	宇通客车	1,066,392.03	0.43
11	601898	中国重工	1,066,310.43	0.43
12	600683	海陆重工	1,054,068.00	0.42
13	600488	烽火通信	1,031,100.00	0.42
14	600070	恒生电子	1,016,130.00	0.41
15	600086	同仁堂	994,267.00	0.41
16	600104	上汽集团	992,146.89	0.40
17	600052	华鲁恒升	970,257.00	0.40
18	600089	特变电工	970,263.04	0.40
19	600032	白云山	961,225.01	0.39
20	600027	百润通	943,700.00	0.38

注:本期累计买入金额按买入金额,不考虑相关交易费用。  
8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600070	恒生电子	6,504,022.28	2.65
2	601796	中国中车	6,499,846.69	2.65
3	600619	康华药业	6,303,627.94	2.57
4	601727	上海电气	6,217,099.57	2.53
5	600276	恒顺醋业	6,086,022.62	2.48
6	600076	东方明珠	6,009,181.66	2.46
7	600037	三安光电	5,761,427.91	2.35
8	600118	中国卫宁	5,761,476.51	2.35
9	600066	宇通客车	5,746,175.11	2.34
10	601106	中国一重	5,584,515.89	2.29
11	600718	高鸿股份	5,560,047.11	2.27
12	600770	世纪股份	5,406,029.69	2.24
13	600488	烽火通信	5,469,072.24	2.23
14	600683	海陆重工	5,448,518.54	2.22
15	600703	三安光电	5,327,529.57	2.17
16	600086	同仁堂	5,243,328.96	2.14
17	600143	金发科技	5,200,232.02	2.12
18	600106	复星医药	5,167,476.97	2.11
19	600036	华鲁恒升	5,119,164.80	2.09
20	600104	上汽集团	5,092,199.88	2.08
21	600027	百润通	5,036,284.44	2.07
22	601898	中国重工	5,086,380.24	2.07
23	600084	上海钢联	5,063,287.27	2.06
24	600100	同方股份	5,061,116.22	2.06

注:本期累计卖出金额按卖出金额,不考虑相关交易费用。  
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额  
单位:人民币元

买入股票成本(成交总额)	卖出股票收入(成交总额)
47,854,401.30	263,411,372.90

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 期末按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  
金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类别	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	契约型开放式	诺安基金管理有限公司	76,096,000.00	80.58

8.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
8.11.2 本基金股指期货持仓和损益明细  
8.12 本基金股指期货投资政策  
8.12.1 本报告期末股指期货投资政策  
8.12.2 本报告期末股指期货投资政策  
8.12.3 本报告期末股指期货投资政策

8.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.13.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.13.2 本基金国债期货投资政策  
8.13.3 报告期末国债期货投资政策

8.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.14.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.14.2 本基金国债期货投资政策  
8.14.3 报告期末国债期货投资政策

8.15 报告期末本基金投资的权证情况  
8.15.1 报告期末本基金投资的权证持仓  
8.15.2 报告期末本基金投资的权证持仓

8.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
8.16.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
8.16.2 本基金股指期货投资政策  
8.16.3 报告期末股指期货投资政策

8.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.17.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.17.2 本基金国债期货投资政策  
8.17.3 报告期末国债期货投资政策

8.18 报告期末本基金投资的权证情况  
8.18.1 报告期末本基金投资的权证持仓  
8.18.2 报告期末本基金投资的权证持仓

8.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
8.19.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
8.19.2 本基金股指期货投资政策  
8.19.3 报告期末股指期货投资政策

8.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.20.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
8.20.2 本基金国债期货投资政策  
8.20.3 报告期末国债期货投资政策

8.21 报告期末按行业分类的股票投资组合  
金额单位:人民币元

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	69,016.00	0.07
B	采矿业	138,740.00	0.16
C	制造业	3,767,820.00	4.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,254.00	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	1,076,467.00	1.23
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
N	批发和零售业	-	-
O	房地产业	-	-
P	住宿和餐饮业	-	-
Q	金融业	-	-
R	住宿和餐饮业	-	-
S	其他	-	-
合计		6,225,971.76	5.94

8.22 报告期末按行业分类的债券投资组合  
8.22.1 报告期末按行业分类的债券投资组合  
8.22.2 报告期末按行业分类的债券投资组合

8.23 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股票投资明细  
金额单位:人民币元

序号	股票代码
----	------