

信息披露disclosure

诺安中证100指数证券投资基金

2018年第四季度报告

注：这是美联储持续释放货币的必然结果，在美股爆发的背景下，全球风险资产都开启了牛市行情，从政策到市场预期，还有国际大宗商品，无一幸免。国际原油的价格本季度下跌幅度高达27%，这自2014年以来以来的最大单季度跌幅。

由于外市市场的拖累，A股市场更是雪上加霜，本季度下跌速度显著加快。此前“中小创原下跌、大盘蓝筹抵抗”的结构分化局面，演变为普跌局面，本季度下跌幅度超过12%，这是自2015股灾以来最大的单季度跌幅。

大盘蓝筹本季度补跌，根本原因因于中国经济基本面进一步下行，由此导致上市公司盈利前景暗淡，以银行股为例说明，本季度经济和货币增速下降超预期，长期（十年期国债）利率水平持续下行，三季度已显著弱化的收益率曲线，本季度重新趋向平坦化。因此银行股补跌是顺理成章的事情。

本基金完全复制中证100指数，年度跟踪误差控制在1%以内，由此实现了对该指数的紧密跟踪。

截至报告期末，本基金份额净值为1.101元。本报告期基金份额净值增长率为-11.85%，同期业绩比较基准收益率为-11.87%。

46 报告期内本基金持有人人数或基金资产净值说明
本报告期末，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资产净值低于五千万元的情况。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	100,028,918.32	91.36
2	其中：股票	100,028,918.32	91.36
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	其他资产	9,091,362.89	8.30
9	合计	109,120,281.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,340,065.54	5.76
B	采矿业	31,131,162.09	28.06
C	制造业	4,400,362.89	3.99
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	7,002,065.00	6.35
E	建筑业	1,670,047.00	1.51
F	批发和零售业	4,091,991.88	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,670,047.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,504,486.02	2.27
J	金融业	49,091,596.88	44.53
K	房地产业	8,021,290.30	7.30
L	租赁和商务服务业	2,464,125.76	2.23
M	科学研究和技术服务业	107,150.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		159,523,667.77	143.88

5.3 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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85
6	001328	交通银行	685,504	3,969,049.64	3.59
7	600016	民生银行	12,430	7,440,038.10	6.75
8	600087	上海机场	352,343	3,463,333.88	3.13
9	601288	农业银行	961,969	3,462,777.04	3.10
10	600000	浦发银行	1,000,000	3,462,777.04	3.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85
6	001328	交通银行	685,504	3,969,049.64	3.59
7	600016	民生银行	12,430	7,440,038.10	6.75
8	600087	上海机场	352,343	3,463,333.88	3.13
9	601288	农业银行	961,969	3,462,777.04	3.10
10	600000	浦发银行	1,000,000	3,462,777.04	3.10

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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

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五名贵金属投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.8 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股指期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.9 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国债期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.10 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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.11 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股指期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.12 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国债期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.13 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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.14 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股指期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.15 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国债期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.16 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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.17 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股指期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.18 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国债期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.19 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

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.20 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股指期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.21 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国债期货投资明细

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	600036	招商银行	34,720	3,811,302.64	3.46
2	603305	润兴股份	1,340	1,461,040.00	1.33
3	601080	中信银行	15,870	501,469.32	0.45
4	601066	华信能源	116,261	4,285,384.48	3.87
5	000061	格力电器	120,021	4,253,448.48	3.85

5.22 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

	资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	1,428,247.37	11.84
8	其他资产	9,823.26	0.08