

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:2015年3月26日

## § 1 重要提示

1.1 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,并对其实质性、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确认,并由董事长签发。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月20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。

本报告财务资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2014年度无保留意见的审计报告,投资者注意阅读。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

基金名称	诺安中证100指数证券投资基金
基金代码	320010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月21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
报告期末基金资产总额	557,735,697.63元
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序和数量化风险管理手段,在对指数成分股的深入研究和分析的基础上,通过数量化方法和模型识别和跟踪误差的最小化,实现对该指数的紧密跟踪。本基金2014年实现收益率为60%,由此为基础持有人创造了满意的回报率。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股基准权重的变化定期调整股票投资组合,在成份股因停牌等原因导致不能买卖时,将通过指数的调整带来的收益,从而为基础持有人创造满意的回报。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,可投资于货币市场基金,其风险和预期收益水平高于货币基金和债券基金。

## 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	潘松云
信息披露负责人	0755-83026688	01096610579
联系电话	0755-83026688	01096610579
电子邮箱	info@noofund.com.cn	custinfo@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-8998	95588
传真	0755-83026677	010966105798

## 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.noofund.com.cn
基金年度报告备查地点	深圳市南山区大冲103号中国银行大厦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  
金额单位:人民币元

项 目	2014年	2013年	2012年
本报告期实现收益	-13,742,803.23	-76,127,845.95	-144,871,408.21
本期利润	236,529,153.50	-89,694,724.19	116,903,659.17
加权平均基金份额利润	0.3208	-0.0783	0.0785
本期基金份额净值增长率为	9.24%	-10.33%	11.25%
3.1.2 期末基金份额和份额 2014年末 2013年末 2012年末			
期初可供分配利润	-0.3125	-0.3403	-0.2636
期末可供分配利润	886,250,497.94	574,317,296.54	1,027,270,786.21
期末可供分配利润	1,051	0.660	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报告期。

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 基金份额净值增长率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(%)	份额净值增长 率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	④	①-③	②-④
过去三个月	53.21%	1.84%	53.14%	1.81%	0.07%	0.03%
过去六个月	70.34%	1.46%	68.20%	1.44%	2.14%	0.02%
过去一年	59.24%	1.28%	56.35%	1.20%	2.89%	0.02%
过去三年	59.24%	1.28%	51.54%	1.27%	7.70%	0.01%
过去五年	5.00%	1.31%	-0.49%	1.31%	5.49%	0.00%
自基金合同生 效以来	8.10%	1.30%	8.01%	1.32%	2.09%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中证100指数收益率×95%+一年期银行存款利率(税后)×5%。

④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。

⑤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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

3.2.2.2 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.3 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.4 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.5 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.6 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.7 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.8 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.9 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.10 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.11 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.12 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.13 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.14 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.15 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.16 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.17 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.18 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.19 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.20 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.21 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.22 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.23 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.24 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.25 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.26 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.27 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.28 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.29 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.30 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.31 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.32 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.33 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.34 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.35 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.36 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.37 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.38 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.39 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.40 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.41 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.42 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.43 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.44 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.45 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.46 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.47 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.48 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.49 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.50 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.51 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.52 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.53 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.54 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.55 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.56 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.57 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.58 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.59 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2.60 与同期业绩比较基准的偏离情况

3.2.2