

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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责任。

基金托管人:中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务数据、净值表现和资产组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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财产，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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	诺安中证100指数
交易代码	320100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月12日
报告期末基金份额总额	153,509,006.62份
投资目标	本基金实施被动式投资，通过严格的投资纪律和风险量化管理手段，不断降低跟踪误差的大小。在正常市场情况下，本基金的跟踪误差的绝对值不超过3.5%，年跟踪误差不超过4%。

本基金采用完全复制策略，按照成份股在中证100指数中的基准权重构建股票组合，并定期根据成份股的基准权重、成交量、停牌情况等变化进行调整，增减构建比例化投资组合。当期期初股票增减和定期发生后，增发、分红等，以及因现金红利的再投资和对本基金跟踪的指数的定期调整带来的变化，基金管理人对投资组合进行适当调整，以更准确地反映指数的组成部分。

4.1 公平交易制度的执行情况

根据《中国证监会2011年修订的〈证券投资基金评价办法〉》，本公司更新并完善了《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、一级市场竞价交易、定期固定关联交易、固定收益类交易、投资组合管理以该投资组合的名义向交易所下达买卖指令、交易中心向银行间市场或交易所买卖协议、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则进行撮合。

投资组合方面，公司设立专门的投资组合适用的证券备选库，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；公司拥有健全的投资授权制度，确保投资组合的授权和权限在授权范围内运作经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并根据该平台所有研究员和投资组合进行评价。

交易执行方面，对于场外交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易系统按时间优先、价格优先的原则对所有投资组合在同一天同一时段下达了相同方向的投资指令，并且所有的指令在同一天内，投资交易系统自动将该交易的每笔买卖单按比例分配到各投资组合；对于一级市场申购、定期固定关联交易、固定收益类交易、投资组合管理以该投资组合的名义向交易所下达买卖指令、交易中心向银行间市场或交易所买卖协议、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则进行撮合。

投资组合在获准进入证券交易所大宗交易的，基金管理人将根据交易所大宗交易的规定，通过该平台进行大宗交易。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的评价情况

报告期内，诺安中证100指数证券投资基金净值增长率为-25.02%，同期业绩比较基准收益率为-25.02%。

本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 主要财务指标

5.3.2 基金净值表现

5.3.3 基金资产净值

5.3.4 基金资产净值

5.3.5 基金资产净值

5.3.6 基金资产净值

5.3.7 基金资产净值

5.3.8 基金资产净值

5.3.9 基金资产净值

5.3.10 基金资产净值

5.3.11 基金资产净值

5.3.12 基金资产净值

5.3.13 基金资产净值

5.3.14 基金资产净值

5.3.15 基金资产净值

5.3.16 基金资产净值

5.3.17 基金资产净值

5.3.18 基金资产净值

5.3.19 基金资产净值

5.3.20 基金资产净值

5.3.21 基金资产净值

5.3.22 基金资产净值

5.3.23 基金资产净值

5.3.24 基金资产净值

5.3.25 基金资产净值

5.3.26 基金资产净值

5.3.27 基金资产净值

5.3.28 基金资产净值

5.3.29 基金资产净值

5.3.30 基金资产净值

5.3.31 基金资产净值

5.3.32 基金资产净值

5.3.33 基金资产净值

5.3.34 基金资产净值

5.3.35 基金资产净值

5.3.36 基金资产净值

5.3.37 基金资产净值

5.3.38 基金资产净值

5.3.39 基金资产净值

5.3.40 基金资产净值

5.3.41 基金资产净值

5.3.42 基金资产净值

5.3.43 基金资产净值

5.3.44 基金资产净值

5.3.45 基金资产净值

5.3.46 基金资产净值

5.3.47 基金资产净值

5.3.48 基金资产净值

5.3.49 基金资产净值

5.3.50 基金资产净值

5.3.51 基金资产净值

5.3.52 基金资产净值

5.3.53 基金资产净值

5.3.54 基金资产净值

5.3.55 基金资产净值

5.3.56 基金资产净值

5.3.57 基金资产净值

5.3.58 基金资产净值

5.3.59 基金资产净值

5.3.60 基金资产净值

5.3.61 基金资产净值

5.3.62 基金资产净值

5.3.63 基金资产净值

5.3.64 基金资产净值

5.3.65 基金资产净值

5.3.66 基金资产净值

5.3.67 基金资产净值

5.3.68 基金资产净值

5.3.69 基金资产净值

5.3.70 基金资产净值

5.3.71 基金资产净值

5.3.72 基金资产净值

5.3.73 基金资产净值

5.3.74 基金资产净值

5.3.75 基金资产净值

5.3.76 基金资产净值

5.3.77 基金资产净值

5.3.78 基金资产净值

5.3.79 基金资产净值

5.3.80 基金资产净值

5.3.81 基金资产净值

5.3.82 基金资产净值

5.3.83 基金资产净值

5.3.84 基金资产净值

5.3.85 基金资产净值

5.3.86 基金资产净值

5.3.87 基金资产净值

5.3.88 基金资产净值

5.3.89 基金资产净值

5.3.90 基金资产净值

5.3.91 基金资产净值

5.3.92 基金资产净值

5.3.93 基金资产净值

5.3.94 基金资产净值

5.3.95 基金资产净值

5.3.96 基金资产净值

5.3.97 基金资产净值

5.3.98 基金资产净值

5.3.99 基金资产净值

5.3.100 基金资产净值

5.3.101 基金资产净值

5.3.102 基金资产净值

5.3.103 基金资产净值

5.3.104 基金资产净值

5.3.105 基金资产净值

5.3.106 基金资产净值

5.3.107 基金资产净值

5.3.108 基金资产净值

5.3.109 基金资产净值

5.3.110 基金资产净值

5.3.111 基金资产净值

5.3.112 基金资产净值

5.3.113 基金资产净值

5.3.114 基金资产净值

5.3.115 基金资产净值

5.3.116 基金资产净值

5.3.117 基金资产净值

5.3.118 基金资产净值

5.3.119 基金资产净值

5.3.120 基金资产净值

5.3.121 基金资产净值

5.3.122 基金资产净值

5.3.123 基金资产净值

5.3.124 基金资产净值

5.3.125 基金资产净值

5.3.126 基金资产净值

5.3.127 基金资产净值