

诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:2016年1月21日

基金业管理人的董事会及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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年1月20日复核了本报中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人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。

本报告告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺安中证500ETF

场内简称:诺安500

交易代码:61020

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2014年7月1日

报告期末基金资产净值:106,090,964.00份

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为交易型开放式基金,采用完全复制法,按照行业在场内的指数构成的权重比例构建股票投资组合,并根据成份股的市场价格或折溢价程度对投资组合进行调整。本基金持有的股票的指数构成的权重比例不同于基金净资产的95%且不违反基金资产的5%。

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。

基金管理人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。

本报告告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:诺安中证500ETF

场内简称:诺安500

交易代码:61020

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2014年7月1日

报告期末基金资产净值:106,090,964.00份

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为交易型开放式基金,采用完全复制法,按照行业在场内的指数构成的权重比例构建股票投资组合,并根据成份股的市场价格或折溢价程度对投资组合进行调整。本基金持有的股票的指数构成的权重比例不同于基金净资产的95%且不违反基金资产的5%。

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。

基金管理人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。

本报告告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

本期累计应收利息 -4,943,061.26

本期已实现收益 76,737,396.05

本期利润 0.3661

期末可供分配利润 206,344,149.65

期末基金净值 1.9636

注:上述各项财务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所列数字。

②本期已实现收益扣减本期累计应收利息、投资收益,其他收入不含扣减价差变动收益扣除相关费用后的余额,本期利润已扣减本期应收利息。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 29.18% 2.20% 24.40% 2.06% 4.78% 0.19%

注:本基金基金合同生效日为2014年3月10日,截至2015年12月31日,中证500指数收益率为-1.03%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基金合同生效以来,中证500指数收益率为-1.03%。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

本期已实现收益 -4,943,061.26

本期利润 76,737,396.05

本期利润 0.3661

期末可供分配利润 206,344,149.65

期末基金净值 1.9636

注:上述各项财务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所列数字。

②本期已实现收益扣减本期累计应收利息、投资收益,其他收入不含扣减价差变动收益扣除相关费用后的余额,本期利润已扣减本期应收利息。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

任本基金的基金经理(或

姓名 职务 任期日期 离任日期

说明

谢海峰 基金经理,任本基金基金经理,2014年10月10日起至2015年12月31日止。

谢海峰 基金经理,任本基金基金经理,2014年10月10日起至2015年12月