

诺安中证100指数证券投资基金

2016年年度报告摘要

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:2017年3月30日

1 重要提示
基金管理人、董事、监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法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月29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。

本财务报告资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2016年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告自2016年1月1日起至12月31日止。

2 基金简介
2.1 基金基本情况

基金名称	诺安中证100指数
基金代码	320010
基金运作方式	契约式开放式
基金合同生效日	2006年10月27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
报告期末基金总资产	129,176,761.80元
基金合同存续期	不定期

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	杨冰	张军
联系电话	0755-82036828	010-65051728
电子邮箱	liu@noanfund.com.cn	liu@noanfund.com.cn
传真	400-888-0808	06608
网址	0755-82036877	010-65051728

2.2 基金信息披露
2.2.1 基金信息披露网站
2.2.2 基金信息披露网站
2.2.3 基金信息披露网站

2.3 基金管理人基本情况
2.3.1 基金管理人基本情况
2.3.2 基金管理人基本情况

2.4 基金业绩表现
2.4.1 基金业绩表现
2.4.2 基金业绩表现

2.5 基金费用
2.5.1 基金费用
2.5.2 基金费用

2.6 基金收益分配
2.6.1 基金收益分配
2.6.2 基金收益分配

2.7 基金风险
2.7.1 基金风险
2.7.2 基金风险

2.8 基金其他
2.8.1 基金其他
2.8.2 基金其他

2.9 基金其他
2.9.1 基金其他
2.9.2 基金其他

2.10 基金其他
2.10.1 基金其他
2.10.2 基金其他

2.11 基金其他
2.11.1 基金其他
2.11.2 基金其他

2.12 基金其他
2.12.1 基金其他
2.12.2 基金其他

2.13 基金其他
2.13.1 基金其他
2.13.2 基金其他

2.14 基金其他
2.14.1 基金其他
2.14.2 基金其他

2.15 基金其他
2.15.1 基金其他
2.15.2 基金其他

2.16 基金其他
2.16.1 基金其他
2.16.2 基金其他

2.17 基金其他
2.17.1 基金其他
2.17.2 基金其他

2.18 基金其他
2.18.1 基金其他
2.18.2 基金其他

2.19 基金其他
2.19.1 基金其他
2.19.2 基金其他

2.20 基金其他
2.20.1 基金其他
2.20.2 基金其他

2.21 基金其他
2.21.1 基金其他
2.21.2 基金其他

2.22 基金其他
2.22.1 基金其他
2.22.2 基金其他

2.23 基金其他
2.23.1 基金其他
2.23.2 基金其他

2.24 基金其他
2.24.1 基金其他
2.24.2 基金其他

2.25 基金其他
2.25.1 基金其他
2.25.2 基金其他

2.26 基金其他
2.26.1 基金其他
2.26.2 基金其他

2.27 基金其他
2.27.1 基金其他
2.27.2 基金其他

2.28 基金其他
2.28.1 基金其他
2.28.2 基金其他

2.29 基金其他
2.29.1 基金其他
2.29.2 基金其他

2.30 基金其他
2.30.1 基金其他
2.30.2 基金其他

2.31 基金其他
2.31.1 基金其他
2.31.2 基金其他

2.32 基金其他
2.32.1 基金其他
2.32.2 基金其他

2.33 基金其他
2.33.1 基金其他
2.33.2 基金其他

2.34 基金其他
2.34.1 基金其他
2.34.2 基金其他

2.35 基金其他
2.35.1 基金其他
2.35.2 基金其他

2.36 基金其他
2.36.1 基金其他
2.36.2 基金其他

2.37 基金其他
2.37.1 基金其他
2.37.2 基金其他

2.38 基金其他
2.38.1 基金其他
2.38.2 基金其他

2.39 基金其他
2.39.1 基金其他
2.39.2 基金其他

2.40 基金其他
2.40.1 基金其他
2.40.2 基金其他

2.41 基金其他
2.41.1 基金其他
2.41.2 基金其他

2.42 基金其他
2.42.1 基金其他
2.42.2 基金其他

2.43 基金其他
2.43.1 基金其他
2.43.2 基金其他

2.44 基金其他
2.44.1 基金其他
2.44.2 基金其他

2.45 基金其他
2.45.1 基金其他
2.45.2 基金其他

2.46 基金其他
2.46.1 基金其他
2.46.2 基金其他

2.47 基金其他
2.47.1 基金其他
2.47.2 基金其他

2.48 基金其他
2.48.1 基金其他
2.48.2 基金其他

2.49 基金其他
2.49.1 基金其他
2.49.2 基金其他

2.50 基金其他
2.50.1 基金其他
2.50.2 基金其他

2.51 基金其他
2.51.1 基金其他
2.51.2 基金其他

2.52 基金其他
2.52.1 基金其他
2.52.2 基金其他

2.53 基金其他
2.53.1 基金其他
2.53.2 基金其他

2.54 基金其他
2.54.1 基金其他
2.54.2 基金其他

2.55 基金其他
2.55.1 基金其他
2.55.2 基金其他

2.56 基金其他
2.56.1 基金其他
2.56.2 基金其他

2.57 基金其他
2.57.1 基金其他
2.57.2 基金其他

2.58 基金其他
2.58.1 基金其他
2.58.2 基金其他

2.59 基金其他
2.59.1 基金其他
2.59.2 基金其他

2.60 基金其他
2.60.1 基金其他
2.60.2 基金其他

2.61 基金其他
2.61.1 基金其他
2.61.2 基金其他

2.62 基金其他
2.62.1 基金其他
2.62.2 基金其他

2.63 基金其他
2.63.1 基金其他
2.63.2 基金其他

2.64 基金其他
2.64.1 基金其他
2.64.2 基金其他

2.65 基金其他
2.65.1 基金其他
2.65.2 基金其他

2.66 基金其他
2.66.1 基金其他
2.66.2 基金其他

2.67 基金其他
2.67.1 基金其他
2.67.2 基金其他

2.68 基金其他
2.68.1 基金其他
2.68.2 基金其他

2.69 基金其他
2.69.1 基金其他
2.69.2 基金其他

2.70 基金其他
2.70.1 基金其他
2.70.2 基金其他

2.71 基金其他
2.71.1 基金其他
2.71.2 基金其他

2.72 基金其他
2.72.1 基金其他
2.72.2 基金其他

2.73 基金其他
2.73.1 基金其他
2.73.2 基金其他

2.74 基金其他
2.74.1 基金其他
2.74.2 基金其他

2.75 基金其他
2.75.1 基金其他
2.75.2 基金其他

2.76 基金其他
2.76.1 基金其他
2.76.2 基金其他

2.77 基金其他
2.77.1 基金其他
2.77.2 基金其他

2.78 基金其他
2.78.1 基金其他
2.78.2 基金其他

2.79 基金其他
2.79.1 基金其他
2.79.2 基金其他

2.80 基金其他
2.80.1 基金其他
2.80.2 基金其他

2.81 基金其他
2.81.1 基金其他
2.81.2 基金其他

2.82 基金其他
2.82.1 基金其他
2.82.2 基金其他

2.83 基金其他
2.83.1 基金其他
2.83.2 基金其他

2.84 基金其他
2.84.1 基金其他
2.84.2 基金其他

2.85 基金其他
2.85.1 基金其他
2.85.2 基金其他

2.86 基金其他
2.86.1 基金其他
2.86.2 基金其他

2.87 基金其他
2.87.1 基金其他
2.87.2 基金其他

2.88 基金其他
2.88.1 基金其他
2.88.2 基金其他

2.89 基金其他
2.89.1 基金其他
2.89.2 基金其他

2.90 基金其他
2.90.1 基金其他
2.90.2 基金其他

2.91 基金其他
2.91.1 基金其他
2.91.2 基金其他

2.92 基金其他
2.92.1 基金其他
2.92.2 基金其他

2.93 基金其他
2.93.1 基金其他
2.93.2 基金其他

2.94 基金其他
2.94.1 基金其他
2.94.2 基金其他

2.95 基金其他
2.95.1 基金其他
2.95.2 基金其他

2.96 基金其他
2.96.1 基金其他
2.96.2 基金其他

2.97 基金其他
2.97.1 基金其他
2.97.2 基金其他

2.98 基金其他
2.98.1 基金其他
2.98.2 基金其他

2.99 基金其他
2.99.1 基金其他
2.99.2 基金其他

2.100 基金其他
2.100.1 基金其他
2.100.2 基金其他

2.101 基金其他
2.101.1 基金其他
2.101.2 基金其他

2.102 基金其他
2.102.1 基金其他
2.102.2 基金其他

2.103 基金其他
2.103.1 基金其他
2.103.2 基金其他

2.104 基金其他
2.104.1 基金其他
2.104.2 基金其他

2.105 基金其他
2.105.1 基金其他
2.105.2 基金其他

2.106 基金其他
2.106.1 基金其他
2.106.2 基金其他

2.107 基金其他
2.107.1 基金其他
2.107.2 基金其他

2.108 基金其他
2.108.1 基金其他
2.108.2 基金其他

2.109 基金其他
2.109.1 基金其他
2.109.2 基金其他

2.110 基金其他
2.110.1 基金其他
2.110.2 基金其他

2.111 基金其他
2.111.1 基金其他
2.111.2 基金其他

2.112 基金其他
2.112.1 基金其他
2.112.2 基金其他

2.113 基金其他
2.113.1 基金其他
2.113.2 基金其他

2.114 基金其他
2.114.1 基金其他
2.114.2 基金其他

2.115 基金其他
2.115.1 基金其他
2.115.2 基金其他

2.116 基金其他
2.116.1 基金其他
2.116.2 基金其他

2.117 基金其他
2.117.1 基金其他
2.117.2 基金其他

2.118 基金其他
2.118.1 基金其他
2.118.2 基金其他

2.119 基金其他
2.119.1 基金其他
2.119.2 基金其他

2.120 基金其他
2.120.1 基金其他
2.120.2 基金其他

2.121 基金其他
2.121.1 基金其他
2.121.2 基金其他

2.122 基金其他
2.122.1 基金其他
2.122.2 基金其他

2.123 基金其他
2.123.1 基金其他
2.123.2 基金其他

2.124 基金其他
2.124.1 基金其他
2.124.2 基金其他

2.125 基金其他
2.125.1 基金其他
2.125.2 基金其他

2.126 基金其他
2.126.1 基金其他
2.126.2 基金其他

2.127 基金其他
2.127.1 基金其他
2.127.2 基金其他

2.128 基金其他
2.128.1 基金其他
2.128.2 基金其他

2.129 基金其他
2.129.1 基金其他
2.129.2 基金其他

2.130 基金其他
2.130.1 基金其他
2.130.2 基金其他

2.131 基金其他
2.131.1 基金其他
2.131.2 基金其他

2.132 基金其他
2.132.1 基金其他
2.132.2 基金其他

2.133 基金其他
2.133.1 基金其他
2.133.2 基金其他

2.134 基金其他
2.134.1 基金其他
2.134.2 基金其他

2.135 基金其他
2.135.1 基金其他
2.135.2 基金其他

2.136 基金其他
2.136.1 基金其他
2.136.2 基金其他

2.137 基金其他
2.137.1 基金其他
2.137.2 基金其他

2.138 基金其他
2.138.1 基金其他
2.138.2 基金其他

2.139 基金其他
2.139.1 基金其他
2.139.2 基金其他

2.140 基金其他
2.140.1 基金其他
2.140.2 基金其他

2.141 基金其他
2.141.1 基金其他
2.141.2 基金其他

2.142 基金其他
2.142.1 基金其他
2.142.2 基金其他

2.143 基金其他
2.143.1 基金其他
2.143.2 基金其他

2.144 基金其他
2.144.1 基金其他
2.144.2 基金其他

2.145 基金其他
2.145.1 基金其他
2.145.2 基金其他

2.146 基金其他
2.146.1 基金其他
2.146.2 基金其他

2.147 基金其他
2.147.1 基金其他
2.147.2 基金其他

2.148 基金其他
2.148.1 基金其他
2.148.2 基金其他

2.149 基金其他
2.149.1 基金其他
2.149.2 基金其他

2.150 基金其他
2.150.1 基金其他
2.150.2 基金其他

2.151 基金其他
2.151.1 基金其他
2.151.2 基金其他

2.152 基金其他
2.152.1 基金其他
2.152.2 基金其他

2.153 基金其他
2.153.1 基金其他
2.153.2 基金其他

2.154 基金其他
2.154.1 基金其他
2.154.2 基金其他

注:①此处基金经理的任职日期为公司作出决议并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内基金基本运作遵规守信情况的说明

报告期内,诺安中证100指数证券投资基金严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规,遵守了《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的控制方法

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,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、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节。

投资研究方面,公司设立完全所有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、投资风格和完整性的不同,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,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单自动按比例拆分到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,交易员在参与申购之前,各投资组合经独立确定申购价格和数量,并将申购指令下达交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果