

诺安中证100指数证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年10月25日

1 重要提示

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。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

2 基金产品概况

基金简称:诺安中证100指数

交易代码:320010

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2000年10月27日

报告期末基金份额总额:163,083,494.08份

基金会计核算方法:本基金核算方法,通过严格的内部控制和内部制度化风险管理,确保基金资产的安全、准确和完整。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告书中的财务资料未经审计。

报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

3 基金产品概况

基金简称:诺安中证100指数

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2000年10月27日

报告期末基金份额总额:163,083,494.08份

基金会计核算方法:本基金核算方法,通过严格的内部控制和内部制度化风险管理,确保基金资产的安全、准确和完整。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告书中的财务资料未经审计。

报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

4 重要提示

基金会计核算方法:本基金核算方法,通过严格的内部控制和内部制度化风险管理,确保基金资产的安全、准确和完整。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告书中的财务资料未经审计。

报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

5 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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 5,375,340.40

2.本期利润 12,769,636.04

3.加权平均基金份额本期利润 0.0706

4.期末基金份额净值 203.514,161.34

5.期末基金份额总额 1,240

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本基金已实现收益指基金利息收入、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本基金的加权平均基金份额本期利润=本期已实现收益/期末基金份额总额。

④本基金的期末基金份额净值=资产净值/期末基金份额总额。

⑤本基金的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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.22 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.23 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.24 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.25 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.26 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.27 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.28 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.29 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.30 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.31 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.32 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.33 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.34 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.35 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.36 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.37 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.38 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.39 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.40 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.41 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.42 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.43 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.44 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④

过去三个月 65.6% 0.61% 42.6% 0.59% 2.32% 0.02%

注:本基金业绩报酬中:中100指数收益率×95%+一年期定期存款利率(税后)×5%。

3.45 本基金合同生效以来基金累计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 收益率差④