

诺安中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

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 10 月 25 日

§1 重要提示

基金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本基金合同规定，于 2016 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 7 日
报告期末基金份额总额	103,090,964.00 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。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

注：本基金上市交易的证券交易所为“上海证券交易所”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	-1,181,190.01
2. 本期利润	5,191,362.81
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0495
4. 期末基金资产净值	170,440,583.30
5. 期末基金份额净值	1.6533

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所列数字。

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。

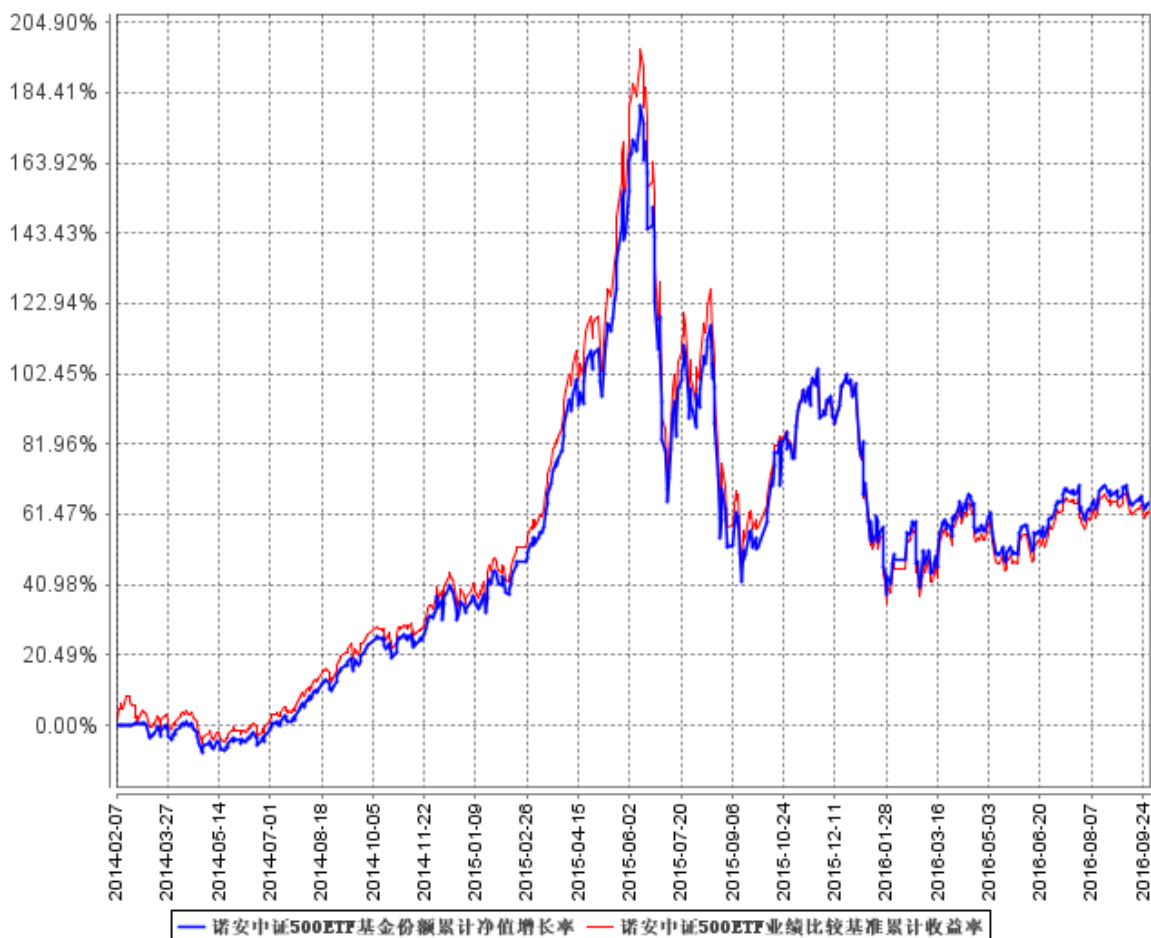
3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	2.98%	0.97%	3.34%	1.01%	-0.36%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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：本基金的建仓期为 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
梅律吾	指数组 负责人， 诺安中 证 100 指 数证券 投资基 金基金 经理、	2014 年 2 月 7 日	-	19	硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证 券公司、鹏华基金管理有限公司；2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任研 究员、基金经理助理、基金经理、研究部 副总监，现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价 值增长股票证券投资基金基金经理， 2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成 长股票型证券投资基金基金经理，2011 年

	诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理				1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月至 2012 年 12 月担任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 2 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间, 诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规, 遵守了《诺安中证 500 交易型开放式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 公平交易专项说明

4.3.1 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相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司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，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，交易中心按照时间优先、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都自动按比例分拆到各投资组合；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的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内，本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整，原因是在较小的最小申赎单位下，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。本基金管理人在量化分析基础上，尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

展望未来一年，从技术角度，不要轻易看多大盘，也不应轻易看空小盘行情；从基本面角度，业绩的持续性确保了上市公司业绩大幅度变动的可能性很小，但是这不并意味行情没有大的波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.6533 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.98%，同期业绩比较基准收益率为 3.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基

金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	163,031,003.42	95.41
	其中：股票	163,031,003.42	95.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,818,215.18	4.58
8	其他资产	16,112.81	0.01
9	合计	170,865,331.41	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,988,365.60	1.75
B	采矿业	6,938,993.58	4.07
C	制造业	96,032,405.06	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,746,205.49	2.78
E	建筑业	5,172,656.05	3.03
F	批发和零售业	9,989,408.60	5.86
G	交通运输、仓储和邮政业	4,985,008.38	2.92
H	住宿和餐饮业	143,585.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,594,112.64	6.22
J	金融业	947,804.00	0.56
K	房地产业	11,307,340.43	6.63
L	租赁和商务服务业	2,341,610.69	1.37
M	科学研究和技术服务业	726,302.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	886,592.70	0.52

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	449,226.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	2,500,530.20	1.47
S	综合	1,590,269.00	0.93
	合计	162,340,415.42	95.25

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	187,500.00	0.11
C	制造业	503,088.00	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	690,588.00	0.41

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300072	三聚环保	24,364	1,062,270.40	0.62
2	002466	天齐锂业	23,760	904,068.00	0.53
3	600522	中天科技	81,300	889,422.00	0.52
4	600584	长电科技	43,559	845,480.19	0.50

5	002405	四维图新	36,879	813,181.95	0.48
6	002085	万丰奥威	39,000	801,060.00	0.47
7	600079	人福医药	38,800	798,892.00	0.47
8	600487	亨通光电	38,650	762,178.00	0.45
9	600201	生物股份	24,005	745,835.35	0.44
10	002310	东方园林	46,900	732,578.00	0.43

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000511	*ST 烯碳	56,400	503,088.00	0.30
2	000693	ST 华泽	15,000	187,500.00	0.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,除万丰奥威外,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2016 年 7 月 2 日,浙江万丰奥威汽轮股份有限公司全资子公司上海达克罗涂复工业有限公司收到上海市宝山区环境保护局出具的《行政处罚决定书》(第 2520160073 号),主要是因为其小部分生产线存在配套建设的环保设施未经验收、在生产过程中有废气产生等问题。宝山区环保局依据国务院《建设项目环境保护管理条例》第二十八条规定,对其作出停止上述生产线加工生产和罚款柒万伍仟元整的行政处罚。现公司已责令上海达克罗及时履行处罚、整改并通过验收,并进一步扩大宁波经济技术开发区达克罗涂复有限公司生产负荷及扩大外协业务,加强学习法律法规,提高环保意识。

截至本报告期末,万丰奥威(002085)为本基金前十大重仓股。从投资角度看,我们认为上述行政监管措施对公司无实质不利影响,并不能改变公司的投资价值和长期竞争力。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的相关规定。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,686.70
2	应收证券清算款	7,036.34
3	应收股利	-
4	应收利息	1,389.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,112.81

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000511	*ST 烯碳	503,088.00	0.30	重大事项
2	000693	ST 华泽	187,500.00	0.11	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	107,090,964.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	4,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	103,090,964.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。

②《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第三季度报告正文。

⑥报告期内诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日