

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017 年第

3 季度报告

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 2017 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

诺安中证创业成长指数分级

场内简称

诺安中创

基金主代码

163209

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2012-03-29

报告期末基金份额总额

19,672,451.65

投资目标

本基金实施被动式投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

投资策略

本基金采用完全复制法，按照成份股在中证创业成长指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证创业成长指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证创业成长指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

业绩比较基准

$95\% \times \text{中证创业成长指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额看，诺安稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；诺安进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

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

下属 3 级基金的基金简称

诺安中创

诺安稳健

诺安进取

下属 3 级基金的场内简称

诺安中创

诺安稳健

诺安进取

下属 3 级基金的交易代码

163209

150073

150075

报告期末下属 3 级基金的份额总额

14,184,366.65

2,195,234.00

3,292,851.00

下属 3 级基金的风险收益特征

较高风险、较高预期收益。

低风险、收益相对稳定。

高风险、高预期收益。

注：注：本基金上市交易的证券交易所为深圳证券交易所，下属分级基金的基金简称、交易代码均为在深圳证券交易所上市交易的简称及交易代码。

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

主基金(元)

A(元)

2017-07-01 - 2017-09-30

B(元)

2017-07-01 - 2017-09-30

C(元)

2017-07-01 - 2017-09-30

本期已实现收益

-383,237.40

本期利润

577,446.07

加权平均基金份额本期利润

0.0291

期末基金资产净值

23,328,858.45

期末基金份额净值

1.186

注：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。

基金净值表现

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

2.77 %

0.89 %

4.92 %

0.95 %

-2.15 %

-0.06 %

注：注：本基金业绩比较基准： $95\% \times$ 中证创业成长指数收益率 $+5\% \times$ 金融同业存款利率。

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 A

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

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 **B**

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

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 C

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

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：注：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。

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 A

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 B

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 C

其他指标

单位：人民币元

其他指标

报告期（2017-07-01 至 2017-09-30）

其他指标

报告期（2017-09-30）

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、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基金经理、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、诺安中小板等权重 ETF 基金经理、诺安上证新兴产业 ETF 基金经理、诺安上证新兴产业 ETF 联接基金经理

2012-07-28

-

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混合型证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月担任诺安成长混合型证券投资基金基金经理,2011年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11月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月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年6月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2017年8月起担任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

李玉良

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金

2015-03-07

-

博士,曾任职于中国工商银行股份有限公司,从事内部风险管理及稽核工作。2010年

6月加入诺安基金管理有限公司，历任产品经理、基金经理助理。2015年3月起任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2015年7月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理，2016年3月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年9月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：注：①此处基金经理的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安中证创业成长指数分级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《诺安中证创业成长指数分级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。

公平交易专项说明

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度国际大宗商品以及国内原材料价格大幅度上涨，这主要是中国政府坚定推行供给侧改革导致，并非实体经济需求拉动。国内实体经济需求仍然乏力，尤其是民间投资与消费比较低迷。尽管如此，原材料价格上涨还是显著促进了上游行业利润的改善。上游的周期类行业上市公司基本面因此大为改观。

由于上市公司基本面改善，再加上流动性环境较为宽松，上半年市场无风险利率上行趋势暂停，因此本季度 A 股市场表现强劲。尤其是周期类股票表现最突出，还有中小市值股票大幅度反弹。非周期类的大盘蓝筹股表现相对平淡。

中证创业成长指数是中小市值股票的代表。该指数在本季度实现涨幅超过 5%。本基金完全复制中证创业成长指数，由此分享该指数上涨带来的收益。

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 1.186 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.77%，同期业绩比较基准收益率为 4.92%。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

投资组合报告

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

权益类投资

21,133,188.44

89.64

其中：股票

21,133,188.44

89.64

2

固定收益投资

-

-

其中：债券

-

-

资产支持证券

-

-

3

贵金属投资

-

-

4

金融衍生品投资

-

-

5

买入返售金融资产

-

-

其中：买断式回购的买入返售金融资产

-

-

6

银行存款和结算备付金合计

2,438,137.75

10.34

7

其他资产

5,323.30

0.02

8

合计

23,576,649.49

100.00

报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

1,819,034.70

7.80

B

采矿业

-

-

C

制造业

11,282,686.26

48.36

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

184,615.34

0.79

E

建筑业

478,452.76

2.05

F

批发和零售业

786,700.68

3.37

G

交通运输、仓储和邮政业

583,899.62

2.50

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

2,493,978.71

10.69

J

金融业

-

-

K

房地产业

341,685.06

1.46

L

租赁和商务服务业

552,751.25

2.37

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

292,185.40

1.25

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

730,258.59

3.13

R

文化、体育和娱乐业

550,409.20

2.36

S

综合

-

-

合计

20,096,657.57

86.15

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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

采矿业

-

-

C

制造业

462,777.95

1.98

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

96,989.40

0.42

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

476,763.52

2.04

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

1,036,530.87

4.44

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A 基础材料

-

-

B 消费者非必需品

-

-

C 消费者常用品

-

-

D 能源

-

-

E 金融

-

-

F 医疗保健

-

-

G 工业

-

-

H 信息技术

-

-

I 电信服务

-

-

J 公用事业

-

-

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

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

300498

温氏股份

63,719

1,370,595.69

5.88

2

002460

赣锋锂业

11,648

1,016,870.40

4.36

3

002466

天齐锂业

12,832

901,961.28

3.87

4

300136

信维通信

16,906

710,052.00

3.04

5

300072

三聚环保

18,711

570,311.28

2.44

6

002572

索菲亚

11,953

451,823.40

1.94

7

002044

美年健康

24,900

423,549.00

1.82

8

002092

中泰化学

26,900

415,605.00

1.78

9

300115

长盈精密

11,633

402,152.81

1.72

10

300017

网宿科技

30,172

364,176.04

1.56

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

300104

乐视网

47,392

476,763.52

2.04

2

002426

胜利精密

40,222

307,698.30

1.32

3

000836

鑫茂科技

25,633

155,079.65

0.66

4

002504

*ST 弘高

11,974

96,989.40

0.42

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

-

-

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

-

-

6

中期票据

-

-

7

可转债（可交换债）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

序号

债券代码

债券名称

数量（张）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,除中泰化学外,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。

新疆中泰化学股份有限公司(以下简称“中泰化学”)于2017年9月29日发布了《新疆中泰化学股份有限公司关于收到国家发展和改革委员会行政处罚决定书的公告》的公告,披露了中泰化学收到了国家发改委的《行政处罚决定书》。其主要原因是公司在2016年度产品销售过程中,存在价格垄断协议。因此被处以罚款,并责令停止。

中泰化学(002092)是本基金组合的前十大重仓股之一。本基金持有该股票,完全依据指数基准,属于被动投资。这次行政处罚就是一次性罚款,对公司业务发展和投资价值的影响非常有限。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

896.93

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

453.57

5

应收申购款

3,972.80

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

5,323.30

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

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

300104

乐视网

476,763.52

2.04

重大事项

2

002426

胜利精密

307,698.30

1.32

重大事项

3

000836

鑫茂科技

155,079.65

0.66

重大事项

4

002504

*ST 弘高

96,989.40

0.42

重大事项

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。

开放式基金份额变动

单位：份

项目

诺安中证创业成长指数分级

诺安中创

诺安稳健

诺安进取

报告期期初基金份额总额

14,109,460.73

2,466,482.00

3,699,723.00

报告期期间基金总申购份额

1,115,957.56

减：报告期期间基金总赎回份额

1,719,171.64

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

678,120.00

-271,248.00

-406,872.00

报告期期末基金份额总额

19,672,451.65

14,184,366.65

2,195,234.00

3,292,851.00

注：注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算份额变动。

基金管理人运用自有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目

诺安中证创业成长指数分级

诺安中创

诺安稳健

诺安进取

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

报告期期末管理人持有的本基金份额

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-

-

-

-

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，敬请投资者留意。

影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安中证创业成长指数分级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诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017 年第三季度报告正文。
- ⑥报告期内诺安中证创业成长指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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。