

# 中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 3 季度报告

公告日期：2015-10-27

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[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](#)
- [自基金合同生效以来基金累计份额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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[报告期内本基金运作遵规守信情况说明](#)

[公平交易专项说明](#)

- [公平交易专项说明](#)
- [公平交易制度和控制方法](#)

□ 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

□ 异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

□ 报告期内基金的业绩表现

□ 报告期内基金投资策略和运作分析

□ 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

指数投资按行业分类的股票投资组合

积极投资按行业分类的股票投资组合

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所有股票投资明细

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所有股票投资明细

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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债券投资明细

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贵金属投资明细

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

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

□ 本基金投资股指期货的投资政策

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

□ 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

□ 本期国债期货投资评价

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

投资组合报告附注

□ 受到调查以及处罚情况

□ 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

□ 其他资产构成

□ 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

□ 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

□ 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

□ 投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固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

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 23 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 2015 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 诺安中小板等权重 ETF

场内简称 中小等权

基金主代码 159921

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2012-12-10

报告期末基金份额总额 31,305,171.00

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

**投资策略** 本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。

**业绩比较基准** 本基金的业绩比较基准为中小板等权重指数收益率。

**风险收益特征** 本基金是股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

**基金管理人** 诺安基金管理有限公司

**基金托管人** 交通银行股份有限公司

**基金保证人** -

注：注：本基金上市交易的证券交易场所为“深圳证券交易所”。

**主要财务指标**

单位：人民币元

项目 2015-07-01 至 2015-09-30(元)

本期已实现收益 -8,306,081.74

本期利润 -19,934,755.26

加权平均基金份额本期利润 -0.6498

期末基金资产净值 49,085,321.08

期末基金份额净值 1.568

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	-26.32%	3.49%	-27.79%	3.73%	1.47%	-0.24%

注：注：本基金的业绩比较基准为：中小板等权重指数收益率。

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

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期 ( 2015-07-01 至 2015-09-30 )

序号 其他指标 报告期 ( 2015-09-30 )

#### 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

宋德舜 上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 2012-12-10 - 8 经济学博士, 具有基金从业资格。曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理, 泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010 年 4 月加入诺安基金管理有限公司, 曾任诺安基金管理有限公司投资经理。2012 年 12 月至 2015 年 3 月任诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2011 年 4 月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理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 2012 年 12 月起任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：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。

#### 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间, 中小板等权重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

《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《中小板等权重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。

## 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。

#### 公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

#### 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业绩表现说明

#### 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1.568元。本报告期基金份额净值增长率为-26.32%,同期业绩比较基准收益率为-27.79%。

#### 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,借助适当的组合优化模型,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

#### 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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,但是这不意味着行情没有大的波动。

#### 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自2015年7月1日至2015年7月29日期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

#### 报告期末基金资产组合情况

金额单位:元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益类投资	45,561,897.55	92.38
	其中：股票	45,561,897.55	92.38
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	3,752,749.74	7.61
7	其他资产	3,104.34	0.01
8	合计	49,317,751.63	100.00

注：注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

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	976,763.53	1.99
B	采矿业	367,401.87	0.75
C	制造业	31,221,094.55	63.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	1,697,517.80	3.46
F	批发和零售业	1,191,525.45	2.43
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	4,580,501.11	9.33
J	金融业	1,634,326.58	3.33
K	房地产业	808,527.98	1.65
L	租赁和商务服务业	2,082,419.47	4.24
M	科学研究和技术服务业	314,496.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	526,114.46	1.07
	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	45,400,688.80	92.49

积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

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	41,078.31	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,530.90	0.09
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	73,599.54	0.15
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	-	-
	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	161,208.75	0.33

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所有股票投资明细

金额单位：元

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	002252	上海莱士	22,624	938,896.00	1.91
2	002183	怡亚通	12,818	937,636.70	1.91
3	002368	太极股份	12,638	828,041.76	1.69
4	002191	劲嘉股份	41,790	803,203.80	1.64
5	002310	东方园林	20,384	780,707.20	1.59
6	002106	莱宝高科	45,432	745,993.44	1.52
7	002236	大华股份	20,639	697,804.59	1.42
8	002594	比亚迪	11,316	679,073.16	1.38
9	002353	杰瑞股份	16,563	661,194.96	1.35
10	002450	康得新	21,389	647,872.81	1.32

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所有股票投资明细

金额单位：元

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	002091 江苏国泰	2,807	73,599.54	0.15
2	002029 七匹狼	4,365	46,530.90	0.09
3	002069 獐子岛	3,731	41,078.31	0.08

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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 - -

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名的前五名债券投资明细

金额单位：元

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。

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

金额单位：元

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持有贵金属。

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

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	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)	-			

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) -

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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债券投资明细

单位：元

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。

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

单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	------------------

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) -

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) -

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。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：元

序号	证券代码	证券名称	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持有资产支持证券。

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,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。

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：元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,417.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,686.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,104.34

## 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号	债券代码	债券名称	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处于转股期的可转换债券。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	---------------	--------------	----------

1	002091	江苏国泰	73,599.54	0.15	重大资产重组
---	--------	------	-----------	------	--------

期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	---------------	--------------	----------

1	002183	怡亚通	937,636.70	1.91	重大事项
2	002368	太极股份	828,041.76	1.69	重大资产重组
3	002191	劲嘉股份	803,203.80	1.64	重大事项
4	002310	东方园林	780,707.20	1.59	重大资产重组
5	002106	莱宝高科	745,993.44	1.52	重大资产重组

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（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目 数值

报告期期初基金份额总额 3,305,171.00

报告期期间基金总申购份额 60,000,000.00

报告期期间总赎回份额 32,000,000.00

报告期期间基金拆分变动份额 -

报告期期末基金份额总额 31,305,171.00

基金管理人运用固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

项目 份额总额(份)

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

单位：份

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没有运用固有资金投资本基金。

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中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。

②《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《中小板等权重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中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第三季度报告正文。

⑥报告期内中小板等权重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。

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.linfund.cm.cn](http://www.linfund.cm.cn) 查阅详情。