诺安中证 100 指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半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 2014 年 8 月 21 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安中证 100 指数
基金主代码	320010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009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
报告期末基金份额总额	719,671,150.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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策略，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，可获取资本市场平均收益率，其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-23,763,024.89
本期利润	-35,133,906.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0462
本期基金份额净值增长率	-6.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3834
期末基金资产净值	443,729,286.58
期末基金份额净值	0.617

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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

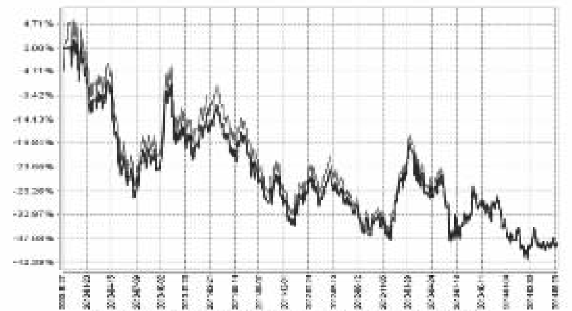
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.82%	0.74%	-0.19%	0.73%	1.01%	0.01%
过去三个月	1.82%	0.87%	0.80%	0.86%	1.02%	0.01%
过去六个月	-6.52%	1.01%	-7.05%	0.99%	0.53%	0.02%
过去一年	-2.53%	1.16%	-4.04%	1.15%	1.51%	0.01%
过去三年	-24.29%	1.22%	-27.43%	1.23%	3.14%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-38.30%	1.27%	-38.75%	1.30%	0.45%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2014 年 6 月，本基金管理人共管理 34 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、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、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安理财宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梅律吾	指数投资组副总监、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	2012年 7 月 28 日	-	16	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、指数投资组副总监。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 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 1 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。

注：①此处基金经理的任职日期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。

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 100 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 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 管理人对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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济整体较为低迷，尤其第一季度下行压力比较大。房地产成为拖累经济的主要因素。房地产市场呈现"量价齐跌"局面。房地产新开工投资出现负增长。境内外投资者甚至对中国经济的信心开始动摇。人民币出现罕见的较大幅度贬值。

二季度由于对外出口回暖，财政政策"托底"开始发挥效应，中国经济逐渐企稳。财政支出主要集中于棚户区改造、铁路建设以及"三农"等领域。实体经济大多数领域都面临去杠杆和去产能的压力，处于信用收缩状态。因此整体表现较为低迷。

从货币与信用环境来看，上半年可概括为"宽货币"与"紧信用"并存局面。国内货币市场利率水平从年初以来持续下行。所以说货币环境比较宽松。但是信用环境比较紧张，表现为实体经济领域的融资成本居高不下，获取信用支持的难度越来越大。其背后说明了市场风险偏好在下降。在信用收缩环境之中，经济低迷在所难免。

国内经济低迷当然会拖累 A 股市场。代表 A 股市场的大盘蓝筹指数上半年跌幅较大。中证 100 属于大盘蓝筹指数，上半年跌幅超过 7%。本基金完全复制中证 100 指数，严格控制跟踪误差，从而实现了对该指数的紧密跟踪。

4.4.2 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 0.617 元。本报告期基金份额净值增长率为-6.52%，同期业绩比较基准收益率为-7.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

定向宽松与"微刺激"政策在下半年将继续发挥效应。房地产限购政策在各地陆续"松绑"，这有助于房地产市场回暖。因此经济企稳回升是可以期待的。但是期望不能太高。实体经济领域去杠杆与去产能仍在进行之中。信用紧缩环境依旧。实体领域的融资成本难以大幅下降。不排除有更多的债务违约出现。因此下半年经济企稳可以期待，但是难以大幅度回升。

下半年 A 股市场比较乐观，尤其是大盘蓝筹股利好因素更多。首先是经济企稳回升，当然有利于大盘蓝筹股。其次是刚性兑付被打破以后，市场无风险利率存在下行空间，有助于大盘蓝筹股估值水平提升。最后是"沪港通"即将启动，A 股市场进一步对外资开放。目前有不少蓝筹股的估值水平低于港股同类股票。因此估值水平向港股看齐是必然趋势。这当然利好 A 股市场的大盘蓝筹股。

中证 100 指数代表 A 股市场的大盘蓝筹股。因此下半年估计会有较好的市场表现。本基金完全复制中证 100 指数，严格控制跟踪误差，保持对该指数的紧密跟踪。由此分享大盘蓝筹股的收益，为本基金持有人创造较为满意的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每次分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对诺安中证 100 证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，诺安中证 100 证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安中证 100 证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，诺安中证 100 证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安中证 100 证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：诺安中证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年 6 月 30 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	30,151,396.88	29,602,403.89
结算备付金	17,680.90	70,658.45
存出保证金	41,907.43	187,290.36
交易性金融资产	414,552,945.29	544,404,177.30
其中：股票投资	414,552,945.29	544,404,177.30
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,981,957.82
应收利息	5,401.01	6,114.44
应收股利	-	-
应收申购款	23,918.10	3,764.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	444,793,249.61	576,256,366.50
负债和所有者权益	本期末 2014年 6 月 30 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	513,020.85	1,128,004.14
应付管理人报酬	274,339.93	375,503.36
应付托管费	54,867.97	75,100.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	43,079.48	219,660.21
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,654.80	140,801.59
负债合计	1,063,963.03	1,939,069.96
所有者权益：		
实收基金	719,671,150.78	870,532,603.08
未分配利润	-275,941,864.20	-296,215,306.54
所有者权益合计	443,729,286.58	574,317,296.54
负债和所有者权益总计	444,793,249.61	576,256,366.50

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.617 元，基金份额总额 719,671,150.78 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	-32,609,895.50	-116,572,984.69
1.利息收入	94,580.87	197,857.06
其中：存款利息收入	94,580.87	196,799.55
债券利息收入	-	1,057.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-21,388,618.27	-19,329,863.23
其中：股票投资收益	-26,838,630.81	-30,846,635.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	266,992.49
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,450,012.54	11,249,779.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-11,370,881.90	-97,687,075.09
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	55,023.80	246,096.57
减：二、费用	2,524,011.29	5,127,234.64
1.管理人报酬	1,749,171.31	3,499,521.89
2.托管费	349,834.22	699,904.42
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	237,302.96	720,197.24
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	187,702.80	207,611.09
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	-35,133,906.79	-121,700,219.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-35,133,906.79	-121,700,219.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：诺安中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	870,532,603.08	-296,215,306.54	574,317,296.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-35,133,906.79	-35,133,906.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-150,861,452.30	55,407,349.13	-95,454,103.17
其中：1.基金申购款	12,525,317.88	-4,727,387.86	7,797,930.02
2.基金赎回款	-163,386,770.18	60,134,736.99	-103,252,033.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	719,671,150.78	-275,941,864.20	443,729,286.58
项目	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,395,006,981.48	-367,736,195.27	1,027,270,786.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-121,700,219.33	-121,700,219.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-261,375,291.52	72,831,803.46	-188,543,488.06
其中：1.基金申购款	111,909,729.65	-30,872,751.84	81,036,977.81
2.基金赎回款	-373,285,021.17	103,704,555.30	-269,580,465.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,133,631,689.96	-416,604,611.14	717,027,078.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

______奥成文______	______薛有为______	____薛有为____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内不存在应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,749,171.31	3,499,521.89
其中：支付销售机构的客户维护费	373,108.48	557,077.24

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.75%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	349,834.22	699,904.42

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	30,151,396.88	92,935.36	46,517,272.84	193,585.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000562	宏源证券	2013年11 月 6 日	重大资产重组	8.22	2014年7 月 28 日	8.93	203,396	1,779,092.07	1,671,915.12	-
601669	中国电建	2014年5 月 20 日	重大事项	2.79	-	-	531,957	2,115,139.15	1,484,160.03	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

②各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 411,396,870.14 元，属于第二层级的余额为 3,156,075.15，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 540,737,506.68 元，第二层级 3,666,670.62 元，无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	414,552,945.29	93.20
	其中：股票	414,552,945.29	93.20
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	30,169,077.78	6.78
7	其他各项资产	71,226.54	0.02
8	合计	444,793,249.61	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	23,013,866.40	5.19
C	制造业	119,970,019.17	27.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,010,238.74	2.71
E	建筑业	14,758,454.96	3.33
F	批发和零售业	3,828,081.44	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	9,343,173.35	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,062,301.72	1.37
J	金融业	202,765,686.87	45.70
K	房地产业	16,429,299.18	3.70
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	2,275,133.07	0.51
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	2,874,423.24	0.65
	合计	413,330,678.14	93.15

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	1,222,267.15	0.28
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	1,222,267.15	0.28

7.3 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

7.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	625,794	24,618,735.96	5.55
2	600036	招商银行	2,159,661	22,114,928.64	4.98
3	600016	民生银行	3,525,868	21,895,640.28	4.93
4	601166	兴业银行	1,497,640	15,021,329.20	3.39
5	601939	建设银行	3,262,771	13,475,244.23	3.04
6	600000	浦发银行	1,466,275	13,269,788.75	2.99
7	600030	中信证券	1,023,436	11,728,576.56	2.64
8	000002	万 科 A	1,296,564	10,722,584.28	2.42
9	600837	海通证券	1,060,266	9,701,433.90	2.19
10	000651	格力电器	313,532	9,233,517.40	2.08
提示：投资者欲了解本报告期末基金的所有股票投资明细，应阅读登载于 www.lionfund.com.cn 网站的半年度报告正文。					

7.3.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600251	冠农股份	81,757	1,222,267.15	0.28

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	2,986,563.76	0.52
2	601901	方正证券	2,686,110.00	0.47
3	600372	中航电子	1,416,326.57	0.25
4	000001	平安银行	1,307,033.00	0.23
5	600887	伊利股份	1,002,042.55	0.17
6	601818	光大银行	998,878.00	0.17
7	600030	中信证券	873,309.00	0.15
8	601989	中国重工	860,155.00	0.15
9	600023	浙能电力	504,804.00	0.09
10	601390	中国中铁	482,437.00	0.08
11	600150	中国船舶	356,927.00	0.06
12	600010	包钢股份	310,151.00	0.05
13	601225	陕西煤业	270,571.00	0.05
14	601857	中国石油	255,380.00	0.04
15	601939	建设银行	243,874.00	0.04
16	601088	中国神华	190,152.61	0.03
17	600000	浦发银行	128,583.00	0.02
18	600111	包钢稀土	112,789.00	0.02
19	600690	青岛海尔	110,130.46	0.02
20	600036	招商银行	90,982.00	0.02

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	5,844,885.90	1.02
2	600016	民生银行	5,473,347.10	0.95
3	600036	招商银行	5,213,808.47	0.91
4	601166	兴业银行	3,524,656.74	0.61
5	600000	浦发银行	3,258,671.84	0.57
6	600837	海通证券	2,725,409.69	0.47
7	601939	建设银行	2,440,353.93	0.42
8	000651	格力电器	2,331,187.31	0.41
9	002142	宁波银行	2,126,299.22	0.37
10	600030	中信证券	2,113,200.25	0.37
11	000002	万 科 A	2,063,090.23	0.36
12	600519	贵州茅台	1,982,136.84	0.35
13	600104	上汽集团	1,887,429.23	0.33
14	601601	中国太保	1,854,206.30	0.32
15	601288	农业银行	1,836,871.97	0.32
16	601328	交通银行	1,801,512.85	0.31
17	601088	中国神华	1,736,538.09	0.30
18	000001	平安银行	1,621,106.47	0.28
19	600887	伊利股份	1,608,305.00	0.28
20	002024	苏宁云商	1,522,950.85	0.27

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	16,423,056.39
卖出股票收入(成交)总额	108,064,775.69

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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投资。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体。除中国平安外，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。

2013 年 10 月 15 日，中国平安保险(集团)股份有限公司董事会披露公告，中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司收到了中国证监会关于"万福生科"事件的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》(〔2013〕48 号)。中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐业务许可 3 个月。

本基金属于指数基金，采用完全复制策略，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。截至本报告期末，中国平安(601318)为中证 100 指数的前十大权重股。

7.12.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,907.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,401.01
5	应收申购款	23,918.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,226.54

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
13,169	54,648.88	60,586,231.05	8.42%	659,084,919.73	91.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,012,463.92	0.2796%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009 年 10 月 27 日)基金份额总额	2,109,735,626.33
本报告期期初基金份额总额	870,532,603.08
本报告期基金总申购份额	12,525,317.88
减：本报告期基金总赎回份额	163,386,770.18
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	719,671,150.78

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	1	94,254,766.37	75.71%	85,811.61	75.71%	-
国元证券	1	30,233,065.71	24.29%	27,524.59	24.29%	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期租用证券公司交易单元无其他证券投资的情况。

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
2014 年 8 月 26 日