

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)

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

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

1

重要提示

(一) 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 2011 年 10 月 25 日证监许可【2011】1705 号文核准公开募集,本基金的基金合同于 2012 年 3 月 29 日正式生效。

(二) 基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》、基金管理人网站公示的《风险说明书》、基金产品风险等级划分方法及说明等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。

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。本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

(五) 基金管理人根据投资者适当性管理办法,对投资者进行分类。投资者应当如实提供个人信息及证明材料,并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。投资者应当知晓并确认当个人信息发生重要变化、可能影响投资者分类和适当性匹配的,应及时主动进行更新。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

2

本招募说明书(更新)已经基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2017 年 9 月 29 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

3

目 录

第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	10

第四部分 基金托管人.....	23
第五部分 相关服务机构.....	25
第六部分 基金份额的分类与净值计算规则.....	51
第七部分 基金的募集.....	54
第八部分 基金合同的生效.....	55
第九部分 诺安稳健份额与诺安进取份额的上市交易.....	56
第十部分 诺安创业成长份额的申购与赎回.....	57
第十一部分 基金的份额配对转换.....	67
第十二部分 基金的投资.....	69
第十三部分 基金的业绩.....	78
第十四部分 基金的财产.....	80
第十五部分 基金财产的估值.....	81
第十六部分 基金的收益与分配.....	85
第十七部分 基金的费用与税收.....	86
第十八部分 基金份额折算.....	88
第十九部分 诺安稳健份额与诺安进取份额的终止运作.....	95
第二十部分 基金的会计与审计.....	96
第二十一部分 基金的信息披露.....	97
第二十二部分 风险揭示.....	101
第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	106
第二十四部分 基金合同内容摘要.....	109
第二十五部分 基金托管协议摘要.....	129
第二十六部分 对基金份额持有人的服务.....	138
第二十七部分 其他应披露事项.....	140
第二十八部分 招募说明书存放及查阅方式.....	142
第二十九部分 备查文件.....	143

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
4

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律、法规及《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书的内容涵盖诺安中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的投资目标、投资理念、投资策略、风险以及认购、申购和赎回的程序及费率等与投资本基金有关的所有相关事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书，并注意基金管理人对本招募说明书披露的更新信息。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、

承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

5

第二部分 释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金：指诺安中证创业成长指数分级证券投资基金；

基金合同：指《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；

招募说明书：指《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期更新；

发售公告：指《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

托管协议 指《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；

中国证监会：指中国证券监督管理委员会；

中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；

《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过的自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；

《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《运作办法》：指 2014 年 7 月 7 日由中国证监会公布并于 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；

《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；

元：指人民币元；

基金管理人：指诺安基金管理有限公司；

基金托管人：指中国银行股份有限公司；

注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

6

投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；

机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资

基金的中国境外的机构投资者；

基金份额持有人大会：指按照基金合同第十二部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；

基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；

基金合同生效日：指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告之日

存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

认购：指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

申购：指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买诺安创业成长份额的行为；

赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将诺安创业成长份额兑换为现金的行为；

基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；

转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；

定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

7
款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；

指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

标的指数 中证创业成长指数；

诺安创业成长份额：本基金的基础份额。投资人在场外认/申购的诺安创业成长份额不进行基金份额分拆；投资人在场内认购的诺安创业成长份额将自动进行基金份额分离；投资人在场内申购的诺安创业成长份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆；

诺安稳健份额：诺安创业成长份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的稳健收益类基金份额；

诺安进取份额：诺安创业成长份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的积极收益类基金份额；

诺安稳健份额的本金：除非基金合同另有所指，对于每份诺安稳健份额而言，指 1.00 元；

巨额赎回：指本基金单个开放日，诺安创业成长份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日全部基金份额（包括诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额）的 10%时的情形；

场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所；

场内：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所；

注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统；

证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统；

上市交易：基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖诺安稳健份额、诺安进取份额的行为；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
8

上市交易公告书：指《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之诺安稳健份额和诺安进取份额上市交易公告书》；

系统内转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为；

跨系统转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为；

自动分离：指投资人在场内认购的每 10 份诺安创业成长份额在发售结束后按 4: 6 比例自动转换为 4 份诺安稳健份额和 6 份诺安进取份额的行为；

配对转换：指本基金的诺安创业成长份额与诺安稳健份额、诺安进取份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并；

分拆：根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 10 份诺安创业成长份额的场内份额申请转换成 4 份诺安稳健份额与 6 份诺安进取份额的行为；

合并：根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 4 份诺安稳健份额与 6 份诺安进取份额申请转换成 10 份诺安创业成长份额的场内份额的行为；

诺安稳健份额约定年基准

收益率：

诺安稳健份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民

币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3.5%”。每份诺安稳健份额年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算，但基金管理人并不承诺或保证诺安稳健份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，诺安稳健份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险；

诺安稳健份额约定累计应得收益：

诺安稳健份额依据约定年基准收益率及基金合同约定的截至计算日的实际天数计算的累计收益；

诺安进取份额应得资产及收益：

在每个会计年度期末，本基金净资产优先分配予诺安稳健份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产；

代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

9
金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；

销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；

基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；

指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；

基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户；

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；

T 日：指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日。

T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入；

基金财产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；

基金财产净值：指基金财产总值减去基金负债后的价值；

基金份额净值：指以计算日基金财产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；

基金财产估值：指计算、评估基金财产和负债的价值，以确定基金财产净值和基金份额净值的过程；

法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、

地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

10

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

公司名称：诺安基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

法定代表人：秦维舟

设立日期：2003 年 12 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

电话：0755—83026688

传真：0755—83026677

联系人：王嘉

股权结构：

股东单位 出资额(万元) 出资比例

中国对外经济贸易信托投资有限公司 6000 40%

深圳市捷隆投资有限公司 6000 40%

大恒新纪元科技股份有限公司 3000 20%

合 计 15000 100%

二、证券投资基金管理情况

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金管理人共管理五十三只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、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、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、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、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

11

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、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本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、诺安积极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、诺安高端制造股票型证券投资基金及诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金。

三、主要人员情况

1. 董事会成员

秦维舟先生，董事长，工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理，香港昌维发展有限公司总经理，香港先锋投资有限公司总经理，中国新纪元有限公司副总裁，诺安基金管理有限公司副董事长。

伊力扎提·艾合买提江先生，副董事长，历任吉通网络通信股份有限公司人力资源部副总经理，中化国际石油公司人力资源部总经理、公司副总经理，中国对外经济贸易信托有限公司副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理。

赵忆波先生，董事，硕士。历任南方航空公司规划发展部项目经理，泰信基金管理有限公司研究员，翰伦投资咨询公司（马丁可利基金）投资经理，纽银西部基金管理有限公司基金经理，现任大恒科技副董事长。

齐斌先生，董事，硕士。历任中国国贸有限责任公司董事会秘书，中国中化集团公司投资部副总经理、战略规划部副总经理。现担任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

12

李清章先生，董事，硕士。历任天津电视台总编室副主任，天津广播电视台宣传管理部副主任。现任上海钟表有限公司董事长，上海摩士达钟表进出口有限公司董事长。

奥成文先生，董事，硕士。历任中国通用技术（集团）控股有限责任公司资产经营部副经理，中国对外经济贸易信托有限公司投资银行部副总经理，诺安基金管理有限公司督察长，现任诺安基金管理有限公司总经理。

汤小青先生，独立董事，博士。历任国家计委财政金融司处长，中国农业银行市场开发部副主任，中国人民银行河南省分行副行长，中国人民银行合作司副司长，中国银监会合作金融监管部副主任，内蒙古银监局、山西银监局局长，中国银监会监管一部主任，招商银行副行长。

史其禄先生，独立董事，博士。历任中国工商银行外汇业务管理处处长，中国工商银行伦敦代表处首席代表，中国工商银行新加坡分行总经理，中国工商银行个人金融业务部副总经理，机构业务部副总经理，机构金融业务部资深专家。

赵玲华女士，独立董事，硕士。历任中国人民解放军空军总医院新闻干事，全国妇女联合会宣传部负责人，中国人民银行人事司综合处副处长，国家外汇管理局政策法规司副处长，中国外汇管理杂志社社长兼主编，国家外汇管理局国际收支司巡视员。

2. 监事会成员

李京先生，监事，企业管理硕士。历任中国中化集团总裁办公室部门经理，中化集团香港立丰实业公司总经理助理，中化汇富资产管理公司副总经理，中化欧洲资本公司副副总

理兼世盈（厦门）创业投资有限公司副总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵星明先生，监事，金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长，深圳证券交易所理事会秘书长，君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生，监事。历任浙江证券深圳营业部交易主管，国泰君安证券公司部门主管，现任诺安基金管理有限公司交易中心总监兼首席交易师（总助级）。

梅律吾先生，监事，硕士。历任长城证券有限责任公司研究员，鹏华基金管理有限公司研究员，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。

3. 经理层成员

奥成文先生，总经理，经济学硕士，经济师。曾任中国通用技术（集团）控股有限责任公司资产经营部副经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

13

年 10 月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作，任公司督察长，现任公司总经理。

杨文先生，副总经理，企业管理学博士。曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员，中融基金管理公司市场部经理。2003 年 8 月加入诺安基金管理有限公司，历任市场部总监、发展战略部总监，现任公司副总经理。

杨谷先生，副总经理，经济学硕士，CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员，西北证券公司资产管理部研究员。2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，现任公司副总经理、权益事业部总经理、投资一部总监、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

陈勇先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理，民生证券公司证券投资总部副总经理。2003 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究部总监、合规与风险控制部总监、督察长。现任公司副总经理、固定收益事业部总经理。

曹园先生，副总经理，本科。曾任职于国泰基金管理有限公司，先后从事于 TA 交易中心交易员、销售部北方区副总经理、北京公司副总经理的工作。2010 年 5 月加入诺安基金管理有限公司，历任华北营销中心总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理、营销事业部总经理。

马宏先生，督察长，硕士。曾任中国新兴（集团）总公司职员、中化财务公司证券部职员、中化国际贸易股份有限公司投资部副总经理、中国对外经济贸易信托投资有限公司证券部投资总监、资产管理二部副总经理、投资发展部总经理。现任公司督察长。

4. 现任基金经理

梅律吾先生，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，现任指数投资组总监。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 指数证券投资基金基金经理，2012 年 7 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，2014 年 1 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 月起任诺安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及中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

李玉良先生，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 月起任诺安优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。

5. 历任基金经理

王坚先生，2012 年 3 月至 2012 年 11 月担任本基金基金经理。

6. 投资决策委员会成员的姓名及职务

本公司投资决策委员会分股票类基金投资决策委员会和固定收益类基金投资决策委员会，具体如下：

股票类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、权益事业部总经理、投资一部总监、基金经理；韩冬燕女士，投资二部执行总监、基金经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

固定收益类基金投资决策委员会：主席由公司总经理奥成文先生担任，委员包括：杨谷先生，副总经理、权益事业部总经理、投资一部总监、基金经理；谢志华先生，基金经理、总裁助理、固定收益事业部副总经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

四、基金管理人的职责

1. 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

- (10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2. 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

16

- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (12) 计算并公告基金财产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

五、基金管理人的承诺

1. 基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2. 基金管理人承诺不从事以下禁止性行为：

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

17

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为及基金合同禁止的行为。

3. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

1. 风险管理及内部控制制度概述

公司风险管理及内部控制是公司为有效防范和控制经营风险和基金资产运作风险，保证公司规范经营、稳健运作，确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整，及时维护公司的良好声誉及股东合法利益，在充分考虑内外部环境因素的基础上，通过构建科学的组织机制、运用有效的管理方法、实施严格的操作程序与控制措施而形成的控制风险的管理系统。公司风险管理及内部控制的总体目标在于建立一个决策科学、运营规范、管理高效、持续健康发展的资产管理实体，在充分保障基金份额持有人利益的基础上，维护公司的良好声誉及公司股东的合法权益。

2. 风险管理制度

(1) 风险管理的具体目标

根据国家相关法律法规及公司内部控制大纲的具体要求，公司风险管理的总体目标为：

1) 确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；

2) 建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；

3) 不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

18

额持有人经风险调整后的利益最大化；

4) 通过严格的风险控制体系和管理措施，保障公司发展战略的顺利实施和经营目标的全面实现，维护公司及公司股东的合法权益；

- 5) 建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度,及时查错防弊、堵塞漏洞,保证各项业务稳健运行;
- 6) 借鉴和引用国际上成熟、先进的风险控制理念和技术,不断提升公司国际化经营水准和核心竞争能力,巩固公司的声誉和市场份额。

(2) 风险管理的原则

公司的风险管理严格遵循以下原则:

- 1) 首要性原则:公司经营管理层将始终把风险管理置于公司经营中的战略层面并作为首要任务;
- 2) 全面性原则:风险管理制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;
- 3) 审慎性原则:公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;
- 4) 独立性原则:合规审查与风险控制委员会、风险控制办公会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性;
- 5) 有效性原则:风险管理制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,并成为所有员工严格遵守的行动指南;
- 6) 适时性原则:风险控制制度的制订应当具有前瞻性。同时,随时对各项制度进行适时的更新、补充和调整,使其适应基金业的发展趋势和最新法律法规的要求;
- 7) 防火墙原则:公司各业务部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

(3) 风险管理的具体内容

- 1) 确立加强风险控制的指导思想,以及风险控制的目标和原则;
- 2) 建立层次分明、权责明确、涵盖全面的风险控制体系;
- 3) 建立定性和定量相结合的风险控制方法;
- 4) 建立严格合理的风险控制程序和措施;
- 5) 制定持续有效的风险控制制度的评价和检查机制。

(4) 风险管理的体系

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

19

- 1) 依据风险管理的具体目标与原则,公司设立了以下风险管理机构及职能部门:
 - a. 董事会下设合规审查与风险控制委员会,负责对公司经营管理和基金投资管理中的合法、合规性进行全面、重点的检查分析评价,对公司经营和基金投资管理中的风险进行合规检查和风险控制评估。并出具相应的工作报告和专业意见提交董事会。
 - b. 公司设督察长。督察长对董事会负责,按照中国证监会的规定和督察长的职责进行工作。
 - c. 公司设风险控制办公会,在总经理的领导下制定公司风险管理制度和政策,对公司研究部风险管理组提交的风险评估报告作出全面的讨论和决定,从而使风险政策得到有力的执行。
 - d. 公司设监察稽核部,监察稽核部直接对总经理负责,同时协助督察长开展工作。监察稽核部在各部门自我监察的基础上依照所规定的职责权限、工作程序进行独立的再监督工作,对公司经营的法律法规风险进行管理和监察,与公司各部门保持相对独立的关系。
 - e. 公司设风险控制部,负责根据公司各类业务的特点和需求,制定各个风险领域

(投资、运作、信用等)的风险管理和绩效评估方法,并监督其执行;定期向管理层提交风险评估报告。

2)为最大限度地实现风险管理的目标,公司以上述机构及职能部门为依托,构建了科学严密,层次分明的风险管理体系,主要分为三个层面:

- a. 第一层面为董事会、合规审查与风险控制委员会;
- b. 第二层面为总经理、督察长、风险控制办公会及监察稽核部、风险控制部;
- c. 第三层面为公司各业务相关部门,对各自部门的风险控制负责;
- d. 公司各风险管理机构及职能部门在上述三个层面上协同运作,建立了严密的风险控制防线,能及时有效地发现、识别、防范及化解公司运营中存在的各种不同类型风险。

3) 数量化的投资风险控制体系

公司针对投资过程中的事前风险、事中风险和事后风险建立了一整套的数量化风险控制体系,从而做到在每个环节有效控制风险点。

投资前的风险控制主要是通过严谨、细致的研究工作,定性与定量相结合的方法来实现。研究员通过实地调研对上市公司作出定性的判断,同时公司还通过量化诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

20

的指标体系,如:风险指标体系(包括标准差、跟踪误差、下方风险、组合 VaR 等)、流动性指标体系等,挑选价值相对被低估的股票,运用数量化模型进行价值评估。

事中的风险控制通过两个手段来实现,一是在交易系统中设置风险控制条目,当基金经理下达与公司风险管理规定不符的指令时,指令将不能被执行,从技术上防止了不当投资行为的发生。第二是高频率的投资情况报告,可随时掌握投资过程中的股票仓位、集中度、流动性多方面的状况。

事后风险控制包括业绩评价和业绩归因,主要是把业绩逐层分解为资产策略配置效应、行业选择效应和个股选择效应,同时为优化投资策略提供参考。

3. 内部控制制度

(1) 内部控制的目标

为在守法经营、规范运作的基础上,实现持续、稳定、健康发展的经营目标,公司内部控制的总体目标为:

- 1) 使公司诚实信用、勤勉尽责地为投资者服务,保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯;
- 2) 保护公司资产的安全,实现公司经营方针和目标,维护股东权益;
- 3) 树立良好的品牌形象,维护公司最重要的资本——声誉;
- 4) 健全公司法人治理结构,建立符合现代管理要求的内部组织结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;
- 5) 建立切实有效的内部控制系统,查错防弊,消除隐患,保证业务稳健运行;
- 6) 规范公司与股东之间的关联交易,避免股东干涉公司正常的经营管理活动。

(2) 内部控制的原则

公司内部控制制度的建立严格遵循以下原则

- 1) 全面性原则:内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节;
- 2) 有效性原则:一方面,通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行;另一方面,强化内部管理制度的高度权威性,任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力;

3) 独立性原则: 公司各机构、部门和岗位在职能上保持相对独立性; 内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立、执行部门, 公司基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离;

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

21

4) 相互制约原则: 公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡, 并通过切实可行的相互制约措施来消除内部控制中的盲点;

5) 成本效益原则: 运用科学化的经营管理方法降低运作成本, 提高经济效益, 以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(3) 内部控制制度的主要内容

内部控制主要包括环境控制和业务控制。

1) 环境控制: 指与内部控制相关的环境因素相互作用的综合效果及其对业务、员工的影响力, 环境控制构成公司内部控制的基础。公司致力于从治理结构、组织机构、企业文化、员工素质控制等方面实现良好的环境控制。

2) 业务控制: 包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、监察稽核控制及其它方面的内部控制等。

a. 投资管理业务控制: 涉及到研究业务控制、投资决策业务控制、基金交易业务控制和对关联方交易的监控:

i) 研究业务控制主要包括:

公司的研究工作应保持独立、客观, 为公司基金投资运作以及公司业务的全局发展提供全方位的支持; 建立科学的研究工作管理流程和投资对象备选库制度; 建立研究与投资的业务交流制度; 建立研究报告质量评价体系。

ii) 投资决策业务控制主要包括:

严格遵守法律法规的有关规定及基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求; 健全投资决策授权制度, 实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制; 投资决策应当有充分的投资依据, 重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持, 并保留决策记录; 建立投资风险评估与管理制; 建立科学的投资管理业绩评价体系; 督察长和监察稽核部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查; 相关业务人员应遵循良好的职业道德规范, 严禁损害基金份额持有人利益事件的发生。

iii) 基金交易业务控制主要包括:

实行集中交易制度; 投资决策和交易执行实行严格的人员和空间分离制度, 建立交易执行的权限控制体系和交易操作规则; 建立完善的交易监测、预警和反馈系统; 执行公平的交易分配制度, 确保不同投资者的利益能够得到公平对待; 建立完善的交易记录制度, 及时核对并存档保管每日投资组合列表等文件; 制

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

22

定相应的特殊交易的流程和规则; 建立科学的交易绩效评价体系; 建立关联方交易的监控制度。

b. 信息披露控制: 公司按照法律、法规和中国证监会的有关规定, 建立完善的信息披露制度, 保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。按照程序进行信息的组织、审核和发布。公司制定了严格的保密制度。公司掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

c. 信息技术系统控制: 公司根据国家法律法规的要求, 遵循安全性、实用性、可操作

性原则，制定了信息系统的管理制度。公司信息技术系统硬件及软件的设计、开发均符合国家、金融行业软件工程标准的要求并实现了全面的业务电子化；公司实行严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度、信息数据的保存和备份制度、信息技术系统的稽核检查制度等管理措施，确保系统安全运行。

d. 会计系统控制：公司根据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制定了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。主要包括以下方面：

明确职责划分与岗位分工；对所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立；基金会计核算独立于公司会计核算；采取适当的会计控制措施；建立凭证制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任；建立账务组织和账务处理体系，有效控制会计记账程序；建立复核制度；采取合理的计价方法和科学的计价程序，公允反映基金所投资的有价证券在计价时点的价值；规范基金清算交割工作，确保基金资产的安全；建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督；制定完善的会计档案保管和财物交接制度，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密；自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

e. 监察稽核控制：公司设立督察长，督察长直接对董事会负责，经董事会聘任，并报中国证监会核准。公司设立监察稽核部，对公司经营层负责，开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

f. 其他内部控制机制：其他内部控制包括对销售和客户服务控制、对基金托管人和基金代销机构等合作方的控制、授权控制、危机处理控制、持续的控制检验等。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

23

第四部分 基金托管人

一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类

齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至 2017 年 06 月 30 日，中国银行已托管 611 只证券投资基金，其中境内基金 574 只，QDII 基金 37 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

24

控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。

先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

25

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

(一)、诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、北京、上海、广州、成都开设五个直销网点对投资者办理开户、申购和赎回等业务：

1、深圳直销中心

办公地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

邮政编码：518048

电话：0755-83026603 或 0755-83026620

传真：0755-83026630

联系人：祁冬灵

2、北京分公司

办公地址：北京市朝阳区光华路甲 14 号诺安大厦 8-9 层

邮政编码：100020

电话：010-59027811

传真：010-59027890

联系人：孟佳

3、上海分公司

办公地址：上海浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪中心大厦 903 室

邮政编码：200120

电话：021-68824617

传真：021-68362099

联系人：王惠如

4、广州分公司

办公地址：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 2908

邮政编码：510623

电话：020-38928980

传真：020-38928980

联系人：黄怡珊

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
26

5、西部营销中心

办公地址：成都市高新区府城大道西段 399 号天府新谷 9 栋 1 单元 1802

邮政编码：610021

电话：028-86050157

传真：028-86050160

联系人：裴兰

6、个人投资者可以通过基金管理人的网上直销交易系统办理本基金的开户、申购和赎回手续，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。

网址：www.lionfund.com.cn

(二)、基金代销机构（排名不分先后）

(1) 场外代销机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

电话：010-66105799

传真：010-66105798

联系人：田耕

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

4) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人: 田国立

电话: 010-66275654

客户服务热线: 95533

网址: www.ccb.com

5) 交通银行股份有限公司

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

电话: 021-58781234

传真: 021-58408842

联系人: 曹榕

客户服务热线: 95559

网址: www.bankcomm.com

6) 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 洪崎

电话: 010-58351666

传真: 010-83914283

联系人: 李群

客户服务热线: 95568

网址: www.cmbc.com.cn

7) 北京银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人: 张东宁

联系人: 谢小华

联系电话: 010-66223587

传真: 010-66226045

客户服务电话: 95526

网址: www.bankofbeijing.com.cn

8) 南京银行股份有限公司

注册地址: 南京市中山路 288 号

法定代表人: 林复

联系人: 贺坚

电话: 025-84544135

传真: 010-84544129

客户服务电话: 95302

网址: www.njcb.com.cn

9) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融?碧玉蓝天大厦 16 至 23 楼

法定代表人：翼光恒

联系人：周睿

电话：021-38576977

传真：021-50105124

客户服务电话：021-962999、4006962999

网址：www.srcb.com

10) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：汤嘉惠、倪苏云

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

11) 兴业银行股份有限公司

注册地址：中国福州市湖东路 154 号

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

29

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

12) 江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：0519-96005

网址：www.jnbank.com.cn

13) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16/17 层

法定代表人：邵崇

电话：0755-83516222

联系人：匡婷

客户服务电话：400-6666-888、0755-33680000（投诉电话）

网址：www.cgws.com

14) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

15) 大通证券股份有限公司

注册地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

办公地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

30

层

法定代表人：赵玺

客户服务热线：4008-169-169

网址：www.daton.com.cn、 www.estock.com.cn

16) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

17) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层—29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层—29 层、32、36、39、40 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

网址：www.dfzq.com.cn

18) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

基金业务对外联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务热线：95531 或 400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

19) 广州证券股份有限公司

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

31

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

20) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客户服务热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

21) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

联系人：武斌

联系电话：0755-83718808

传真：0755-83711597

客户服务电话：95563、0771-95563

网址：www.ghzq.com.cn

22) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

32

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

全国统一服务热线：95310

网址：www.gjq.com.cn

23) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：袁丽萍

客户服务电话：400-888-5288、95570

网址：www.glsc.com.cn

24) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务热线：95521

网址：www.gtja.com

25) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务热线：95553、4008888001

网址：www.htsce.com

26) 华安证券股份有限公司

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

33

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

客户服务热线：95318

网址：www.hazq.com

27) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

客户服务电话：95390、400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

28) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

客户服务热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

29) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

联系人：徐世旺

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

30) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

34

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国甸

电话：025-83364032

传真：025-83320066

联系人：胥春阳

客户服务热线：95386

网址：www.njq.com.cn

31) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

开放式基金咨询电话：0531-81283906

开放式基金业务传真：0531-81283900

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

32) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

电话：021-63231111

联系人：王伟力

客服服务热线：4008918918、021-962518

网址：www.962518.com、www.shzq.com

33) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33389888

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

35

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn 、www.swhysc.com

34) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005

室

办公地址：北京西城区太桥大街 19 号

法定代表人：韩志谦

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

35) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

36) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客户服务电话：4008096096、95355

网址：www.swsc.com.cn

37) 湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

36

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：陈伟

客户服务热线：400-888-1551、021-38784525

网址：www.xcsc.com

38) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

39) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号西海国际中心 1 号楼 15 层

法人代表：田德军

联系电话：010-83561149

传真：010-83561094

客户服务热线：95399

网址：www.xsdzq.cn

40) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

电话：0791-83811898

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

客户服务热线：95335、400-88-95335

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

37

网址：www.avicsec.com

41) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：钱华

客户服务电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

42) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市河西区宾水道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

网址：www.ewww.com.cn

43) 方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

44) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：(8621) 2216 9999

传真：(8621) 6215 1789

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

45) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、10、18、19、35、36、38、39-44 楼

法定代表人: 孙树明

统一客户服务电话: 95575

开放式基金业务传真: 020-87555305

网址: <http://new.gf.com.cn>

46) 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人: 曹实凡

电话: 4008866338

联系人: 袁月

客户服务电话: 95511-8

网址: <http://stock.pingan.com>

47) 山西证券股份有限公司

注册地址: 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心

办公地址: 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26-30 层

法定代表人: 侯巍

联系人: 张治国

电话: 0351-8686703

传真: 0351-8686619

客户服务电话: 95573

网址: www.i618.com.cn

48) 国融证券股份有限公司

注册地址: 内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川立农村镇银行股份有限公司四楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 4 号楼 11 层国融证券

法定代表人: 张智河

联系人: 张利军、陈韦杉

客户服务电话: 400-660-9839、95385

网址: www.grzq.com

49) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 陈忠

电话: 010-84683893

传真: 010-84865560

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

50) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号中信建投证券公司

法定代表人：王常青

开放式基金咨询电话：4008-888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

客户服务电话：95587

网址：www.csc108.com

51) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

52) 华西证券股份有限公司

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

40

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：400-8888-818、95584

网址：www.hx168.com.cn

53) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层

法定代表人：陈共炎

电话：010-66568430

传真：010-66568532

联系人：田薇

客户服务电话：400-8888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

54) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客户服务热线：95360

网址: www.nesc.cn

55) 中国中投证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 18-21 层

办公地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 18-21 层

法定代表人: 高涛

客户服务热线: 95532、4006008008

网址: www.china-invs.cn

56) 民生证券股份有限公司

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
41

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

法定代表人: 冯鹤年

联系人: 赵明

联系电话: 010-85127622

客服电话: 4006198888

公司网站: www.msyzq.com

57) 中银国际证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址: 中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39、40、41 层

法定代表人: 宁敏

联系人: 张静

联系电话: 021-68604866

客户服务电话: 400-620-8888、021-61195566

公司网站: www.bocichina.com

58) 大同证券有限责任公司

注册地址: 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址: 山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 13 层

法定代表人: 董祥

客户服务电话: 4007-121-212

网址: www.dtsbc.com.cn

59) 联储证券有限责任公司

注册地址: 广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号金砖大厦 8 楼

法定代表人: 沙常明

联系人: 丁倩云

联系电话: 010-56177851

客户服务电话: 400-620-6868

网址: www.lczq.com

60) 天相投资顾问有限公司

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
42

注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045678

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

天相投顾网-网址：www.txsec.com

天相基金网-网址：www.jjm.com.cn

61) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法人代表人：马勇

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://money.jrj.com.cn>

62) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焯

电话：021-20691869

传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

63) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

客户服务电话：400-1818-188、95021

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
43

网址：www.1234567.com.cn

64) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

65) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

66) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn;www.jjmmw.com

67) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

68) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

44

网址：licaike.hexun.com

69) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

70) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴 1318 号星展银行大厦 1003 单元；

上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客户服务电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

71) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号金诚集团 10 楼

法定代表人：徐黎云

联系人：周立枫

联系电话：0571-88337788

客户服务电话：400-068-0058

网址：www.jincheng-fund.com

72) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
45

73) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

联系人：魏可好

客服电话：400-821-5399

网站：www.noah-fund.com

74) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层
5312-15 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 12-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

75) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：胡学勤

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

76) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区亮马桥路 40 号二十一世纪大厦 A 座 303 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院泰康金融大厦 38 号

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-8199-868

公司网址：www.tdyhfund.com

77) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

46

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

联系电话：021-63333319

客户服务电话：400-643-3389

网址：www.vstonewealth.com

78) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411999

公司网址：www.haojiyou.cn

79) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：钟琛

联系电话：020-89629012

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

80) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法人代表：燕斌

联系人：陈东

客户服务电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

81) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期
47

法定代表人：钱昊旻

客户服务电话：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

82) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶建

联系电话：0755-89460500

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

83) 北京广源达信基金销售有限公司（原北京广源达信投资管理有限公司）

地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层

法人代表：齐剑辉

客户服务电话：400-623-6060

网址：www.niuniufund.com

84) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

联系电话：010-62680527

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

85) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

48

联系人：付文红

电话：010-62675369

传真：8610-62675979

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

86) 北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 区

法定代表人：程刚

客户服务电话：400-100-3391

网址：www.dianyingfund.com

87) 北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号国投尚科大厦

法定代表人：许现良

联系人：王芳芳

电话：18519215322

客户服务电话：4001-500-882

网址：www.lanmao.com

88) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

89) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院

法定代表人：江卉

客户服务电话：95118 或 400 098 8511（个人业务）、400 088 8816（企业业务）

网址: <http://fund.jd.com>

90) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)

办公地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

法定代表人: 王翔

联系人: 蓝杰

联系电话: 021-65370077-220

客户服务电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

91) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

注册地址: 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址: 北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 凤凰金融 18 号楼

法定代表人: 程刚

客户服务电话: 400-8105-919

网址: www.fengfd.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售基金, 并及时公告。

(2) 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。

二、 注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 周明

电话: 010- 58598839

传真: 010-58598907

三、 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称: 北京市德恒律师事务所

住所: 中国北京西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

法定代表人/负责人: 王丽

电话: 010-66575888

传真: 010-65232181

经办律师: 徐建军、李晓明

四、 审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场 E2 座 8 层

执行事务合伙人: 邹俊

电话: 010 85085000

传真: 010 85185111

联系人: 左艳霞

经办注册会计师：左艳霞、张品

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

51

第六部分 基金份额的分类与净值计算规则

一、基金份额结构

本基金的基金份额包括诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（即“诺安创业成长份额”）、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“诺安稳健份额”）与诺安中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“诺安进取份额”）。其中，诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

二、基金份额的自动分离与分拆规则

基金发售结束后，本基金将投资人在场内认购的全部诺安创业成长份额按照 4:6 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即诺安稳健份额和诺安进取份额。

根据诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额比例，诺安稳健份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 40%，诺安进取份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 60%，且两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，诺安创业成长份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。诺安稳健份额与诺安进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资人可在场内申购和赎回诺安创业成长份额，投资人可选择将其场内申购的诺安创业成长份额按 4:6 的比例分拆成诺安稳健份额和诺安进取份额。投资人可按 4:6 的配比将其持有的诺安稳健份额和诺安进取份额申请合并为诺安创业成长份额后赎回。

投资人可在场外申购和赎回诺安创业成长份额。场外申购的诺安创业成长份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资人可将其持有的场外诺安创业成长份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成诺安稳健份额和诺安进取份额后上市交易。投资人可按 4:6 的配比将其持有的诺安稳健份额和诺安进取份额合并为诺安创业成长份额后赎回。

无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见招募说明书“第十八部分 基金份额折算”），其所产生的诺安创业成长份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的诺安创业成长份额按 4:6 的比例分拆为诺安稳健份额和诺安进取份额。

三、诺安稳健份额和诺安进取份额的参考净值计算规则

根据诺安稳健份额和诺安进取份额的风险和收益特性不同，本基金份额所分离的两类基金份额诺安稳健份额和诺安进取份额具有不同的参考净值计算规则。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的参考净值计算规则对诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

52

安稳健份额和诺安进取份额分别进行参考净值计算，诺安稳健份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金净资产优先确保诺安稳健份额的本金及诺安稳健份额累计约定应得收益；诺安进取份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金在优先确保诺安稳健份额的本金及累计约定应得收益后，将剩余净资产计为诺安进取份额的净资产。

在本基金存续期内，诺安稳健份额和诺安进取份额的参考净值计算规则如下：

1.诺安稳健份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）

+3.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3.5%”。年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算；

2.本基金每个工作日对诺安稳健份额和诺安进取份额进行参考净值计算。在进行诺安稳健份额和诺安进取份额各自的参考净值计算时，本基金净资产优先确保诺安稳健份额的本金及诺安稳健份额累计约定应得收益，之后的剩余净资产计为诺安进取份额的净资产。诺安稳健份额累计约定应得收益按依据诺安稳健份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日诺安稳健份额应计收益的天数确定；

3. 每 10 份诺安创业成长份额所代表的 4 份诺安稳健份额和 6 份诺安进取份额分别计入诺安稳健份额总额和诺安进取份额总额进行参考净值计算，并将分别按分离后的诺安稳健份额和诺安进取份额的份额数享有获得份额折算的权利，每 10 份诺安创业成长份额所代表的资产净值等于 4 份诺安稳健份额和 6 份诺安进取份额的资产净值之和；

4.在本基金的基金合同生效日所在会计年度或存续的某一完整会计年度内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算，则诺安稳健份额在参考净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或该会计年度年初至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则诺安稳健份额在参考净值计算日应计收益的天数应按照最近一次该会计年度内不定期份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证诺安稳健份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，诺安稳健份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

四、基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照诺安稳健份额和诺安进取份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额参
诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

53

考净值：

1.诺安创业成长份额的参考净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日诺安创业成长份额的基金份额净值= T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金， T 日本基金基金份额的总数为诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的份额数之和。

2.诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额参考净值计算

= $1+R$

t

NAV N

诺安稳健 ()

10 4

=

6

NAV NAV

NAV

创业成长 诺安稳健

诺安进取

设 T 日为诺安稳健、诺安进取基金份额参考净值计算日， $T=1,2,3??N$ ； N 为当年实际

天数； $t=\min\{\text{自年初至 } T \text{ 日, 自基金合同生效日至 } T \text{ 日, 自最近一次会计年度内份额折算日至 } T \text{ 日}\}$ ；

NAV 创业成长

为 T 日每份诺安创业成长份额的基金份额净值；

NAV 诺安稳健

为 T

日诺安稳健份额的基金份额参考净值；

NAV 诺安进取

为 T 日诺安进取份额的基金份额参考净

值；R 为诺安稳健份额约定年基准收益率。

诺安创业成长份额净值、诺安稳健份额参考净值、诺安进取份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

54

第七部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2011 年 10 月 25 日证监许可【2011】1705 号文核准。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期限为不定期。

本基金募集期间基金份额净值为人民币 1.00 元，按面值发售。

本基金于自 2012 年 2 月 27 日至 2012 年 3 月 23 日向全社会公开募集，基金募集工作已于 2012 年 3 月 23 日结束。

本基金募集的有效认购总户数为 3368 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计 1,209,176,634.92 份。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

55

第八部分 基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2012 年 3 月 29 日正式生效。

自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

56

第九部分 诺安稳健份额与诺安进取份额的上市交易

一、上市交易的基金份额

《基金合同》生效后，基金管理人将根据有关规定，申请诺安稳健份额与诺安进取份额上市交易。

二、上市交易的地点

本基金诺安稳健份额与诺安进取份额上市交易的地点为深圳证券交易所。

三、上市交易的时间

本基金诺安稳健份额与诺安进取份额于 2012 年 4 月 27 日起在深圳证券交易所上市交易。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1. 诺安创业成长份额所分离的诺安稳健份额与诺安进取份额以不同的交易代码上市交

- 易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的参考净值；
2. 诺安稳健份额与诺安进取份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
 3. 诺安稳健份额与诺安进取份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；
 4. 诺安稳健份额与诺安进取份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
 5. 诺安稳健份额与诺安进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

五、上市交易的费用

诺安稳健份额与诺安进取份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

诺安稳健份额与诺安进取份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额参考净值。

七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

诺安稳健份额与诺安进取份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

八、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

57

第十部分 诺安创业成长份额的申购与赎回

本基金的诺安稳健份额、诺安进取份额不接受投资人的申购与赎回。

本基金的基金合同生效后，投资人可通过场内或场外两种方式对诺安创业成长份额进行申购与赎回。

一、申购与赎回场所

诺安创业成长份额的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人办理诺安创业成长份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理诺安创业成长份额场内申购、赎回业务。

投资人办理诺安创业成长份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理诺安创业成长份额场外申购、赎回业务。本基金场内、场外代销机构名单参见本招募说明书“第五部分 相关服务机构”相关内容及基金份额发售公告或其他公告。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理诺安创业成长份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理诺安创业成长份额的申购和赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

二、申购与赎回的账户

投资人办理诺安创业成长份额申购、赎回应使用经本基金注册登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜详见基金份额发售公告或相关业务公告）。

三、申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为诺安创业成长份额的申购、赎回开放日。场内业务办理时间为深圳证券交易所交易日交易时间，场外业务办理时间以各销售机构的规定为准，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在基

金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

2、申购、赎回的开始时间

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

58

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理诺安创业成长份额的申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理诺安创业成长份额的赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。

3、若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购/赎回的时间进行调整，但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 2 日前在至少一家指定媒体公告。

4、投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日的相应价格。

四、申购与赎回的原则

1.按“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的诺安创业成长份额净值为基准进行计算；

2.按“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3.赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4.当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5.投资人通过深圳证券交易所交易系统办理诺安创业成长份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购诺安创业成长份额申请时，须按销售机构规定的方式全额交付申购资金。投资人提交诺安创业成长份额赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的诺安创业成长份额余额。否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

59

2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不

成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

4. 申购与赎回的登记结算

（1）投资人 T 日申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记结算手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

（2）投资人 T 日赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

（3）在法律法规允许的范围内，本基金注册登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定予以公告。

六、申购与赎回的限制

1、投资人通过场外办理诺安创业成长份额申购时，通过本公司直销中心、其他销售机构每个基金账户首次申购的最低金额为 1,000 元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 1,000 元（含申购费）。通过本公司网上交易系统（目前仅对个人投资者开通）每个基金账户首次申购的最低金额为 100 元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 100 元（含申购费）。

投资人通过场内办理诺安创业成长份额申购时，每笔申购金额最低为 1,000 元。

2、基金份额持有人办理诺安创业成长份额场外赎回时，通过本公司直销中心、其他销售机构，基金份额持有人赎回本基金的最低份额为 100 份基金份额。通过本公司网上直销平台赎回上述基金，单笔赎回申请的最低份额不作限制。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致该基金份额持有人在同一个网点的基金份额余额少于相应的最低诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

60

赎回限额时，余额部分的基金份额必须一同赎回。

基金份额持有人办理诺安创业成长份额场内赎回时，每笔赎回申请的最低份额为 100 份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额，且单笔赎回最多不超过 99,999,999 份基金份额。

3、各代销机构对上述最低申购限额、交易级差、最低赎回份额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

4、投资人将场外申购的诺安创业成长份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

5、本基金不对单个投资人累计持有的诺安创业成长份额上限进行限制。

6、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的申购金额、赎回份额及持有份额的数量限制，基金管理人按照《信息披露管理办法》必须在调整生效 2 日内至少在一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

七、申购与赎回的费用

1. 申购费率

诺安创业成长份额的场外申购费率如下：

申购金额（M） 申购费率

M < 50 万元 1.20%

50 万元 ≤ M < 100 万元 0.80%

100 万元 ≤ M < 200 万元 0.50%

200 万元 ≤ M < 500 万元 0.30%

M ≥ 500 万元 每笔 1000 元

诺安创业成长份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

2. 赎回费率

诺安创业成长份额的赎回费率随持有期递减，最高不超过赎回总金额的 0.5%。具体费率如下：

场外赎回费

持有年限 T 赎回费率

T < 1 年 0.50%

1 年 ≤ T < 2 年 0.20%

T ≥ 2 年 0.00%

场内赎回费 本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

61

注：1 年指 365 天，2 年指 730 天。

从场内转托管至场外的诺安创业成长份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

3. 诺安创业成长份额的申购费在投资人申购基金份额时收取。诺安创业成长份额的赎回费在投资人赎回基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

4. 诺安创业成长份额的申购费用由提出申购申请并成功确认的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5. 诺安创业成长份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6. 基金管理人可以在法律法规和基金合同约定的范围内调整费率或收费方式。费率或计算方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施 2 日内，依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率，并另行公告。

八、申购和赎回金额的计算方式

1. 本基金诺安创业成长份额申购份额的计算：

诺安创业成长份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

(注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

(注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用 = 固定申购费金额)

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

场内申购时，申购份额的计算保留至整数位，小数点以后的部分舍去，不足 1 份对应的申购资金返还至投资人资金账户。

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2. 本基金基础份额赎回金额的计算：

基础份额赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，

计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

本基金场内和场外赎回时，赎回金额均为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用后的余额，赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3. 本基金基金份额净值的计算：

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

九、申购和赎回的注册登记

1. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的诺安创业成长份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的诺安创业成长份额或上市交易买入的诺安稳健份额、诺安进取份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2. 登记在证券登记结算系统中的诺安创业成长份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的诺安稳健份额和诺安进取份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 4: 6 比例申请合并为诺安创业成长份额后再申请场内赎回。

3. 登记在注册登记系统中的诺安创业成长份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人进行申请按 4: 6 比例分离为诺安稳健份额和诺安进取份额后在深圳证券交易所上市交易。

十、拒绝或暂停接受申购的情况及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常工作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形（除第 4 项外）且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1.因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时向中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，未支付部分由基金管理人按照发生的情况以及本基金合同的约定制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。暂停诺安创业成长份额的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

十二、巨额赎回的情形及处理方式

1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的诺安创业成长份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日全部基金份额(包括诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额)的诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

64

10%，即认为是发生了巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日全部基金份额(包括诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额)的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的诺安创业成长份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所相应规则进行处理；基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

(3)暂停赎回：诺安创业成长份额连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受诺安创业成长份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在至少一家指定媒体公告。

3.巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并按照规定在指定媒体上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

65

开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的诺安创业成长份额净值。

3.如发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按照规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的诺安创业成长份额净值。

十四、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办诺安创业成长份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

十五、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

1.基金份额的登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的诺安创业成长份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的诺安创业成长份额或上市交易买入的诺安稳健份额、诺安进取份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

(2) 登记在证券登记结算系统中的诺安创业成长份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的诺安稳健份额和诺安进取份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 4: 6 比例申请合并为诺安创业成长份额后再申请场内赎回。

(3) 登记在注册登记系统中的诺安创业成长份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人申请按 4: 6 比例分离为诺安稳健份额和诺安进取份额后在深圳证券交易所上市交易。

2.系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理诺安创业成长份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有诺安创业成长份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理诺安创业成长份额场内赎回或诺安稳健份额和诺安进取份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

3.跨系统转托管

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

66

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的诺安创业成长份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2) 诺安创业成长份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司

及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

十六、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为。基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

十七、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十八、基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

67

第十一部分 基金的份额配对转换

本基金《基金合同》生效后，在诺安稳健份额、诺安进取份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

一、份额配对转换是指本基金的诺安创业成长份额与诺安稳健份额、诺安进取份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1.分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每十份诺安创业成长份额的场内份额申请转换成四份诺安稳健份额与六份诺安进取份额的行为。

2.合并

合并指基金份额持有人将其持有的每四份诺安稳健份额与六份诺安进取份额申请转换成十份诺安创业成长份额的场内份额的行为。

二、份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

三、份额配对转换的业务办理时间

本基金已于 2012 年 4 月 27 日起为基金份额持有人开通办理份额配对转换业务。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转

换时除外），具体的业务办理时间见基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

四、份额配对转换的原则

1. 份额配对转换以份额申请。

2. 申请分拆为诺安稳健份额和诺安进取份额的诺安创业成长份额的场内份额必须是十的倍数。

3. 申请合并为诺安创业成长份额的诺安稳健份额与诺安进取份额必须同时配对申请，且基金份额数必须满足比例 4:6。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

68

4. 诺安创业成长份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为诺安创业成长份额的场内份额后方可进行。

5. 份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

六、暂停份额配对转换的情形

1. 深圳证券交易所、基金注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2. 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

七、份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

69

第十二部分 基金的投资

一、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%。

二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

三、投资理念

与主动式投资相比较，被动式投资有着运营成本较低、投资透明化等优点，本基金秉承被动式投资理念，以跟踪中证创业成长指数为投资原则，通过投资于创业板、中小板以及部分主板市场上市的具备创业和高成长特征的中证创业成长指数成份股，更为有效地分散中小市值公司较高的非系统风险，获取长期的投资回报。

四、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。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证创业成长指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

70

根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。

2、股票投资组合构建

本基金采用完全复制制指数的方法，按照成份股在基准指数中证创业成长指数中的基准权重构建股票投资组合。

当发生下列特殊情况时：

- （1）因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- （2）预期标的指数的成份股即将调整；
- （3）存在其他影响指数复制的因素。

基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，对本基金投资组合进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，获得更接近基准指数的收益率。

3、股票投资组合调整

- （1）因基准指数成份股变动进行的调整

①定期调整

本基金股票指数化投资组合将根据基准指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法，以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

②不定期调整

当上市公司发生增发、配股、公司合并等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

当指数成份股权重发生变动时，对因股票停牌而无法交易的股票，本基金将用现金进行

正向或逆向替代，待股票复牌后进行相应调整。

成份股在基准指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

(2) 其他因素引起的调整

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

71

①新股因素

本基金将根据市场情况，决定是否参加首次公开发行（或增发）的新股市值配售与认购，由此得到的非基准指数成份股将在其规定持有期之后的 30 个交易日以内卖出；

②投资比例限制因素

根据法律法规中针对基金投资比例的限制规定，当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过法律法规的规定限制时，本基金将对投资组合进行相应调整，以保证基金投资行为的合法合规性；

③申购、赎回因素

本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，以保证基金正常运行从而有效跟踪标的指数；

④法律法规因素

对于基金管理人、托管人和与其有控股关系的股东发行或者承销的基准指数成份股，法律法规禁止投资而本基金无法获得豁免的，将用技术方法对其进行替换。

4、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

五、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证创业成长指数。

如果标的指数被停止编制及发布、或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外）、或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数、或市场有其他更适合投资的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，变更本基金的标的指数，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

2、业绩比较基准

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

由于本基金投资标的指数为中证创业成长指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证创业成长指数收益率} + 5\% \text{金融同业存款利率}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推
诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

72

出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

六、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。

七、投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
 - (2) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；
 - (3) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

73

- (4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；
其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- (8) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；
本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；
- (9) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；
- (10) 法律法规、中国证监会规定的其他投资比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准；如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

八、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

九、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2017 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

74

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 21,919,101.34 92.75

其中：股票 21,919,101.34 92.75

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 1,703,142.09 7.21

8 其他资产 11,229.61 0.05

9 合计 23,633,473.04 100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 1,976,811.82 8.45

B 采矿业 --

C 制造业 10,976,607.24 46.89

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 194,944.38 0.83

E 建筑业 520,393.98 2.22

F 批发和零售业 655,953.57 2.80

G 交通运输、仓储和邮政业 315,110.70 1.35

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,757,612.51 11.78

J 金融业 --

K 房地产业 337,326.70 1.44

L 租赁和商务服务业 538,973.32 2.30

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 265,418.46 1.13

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 792,556.26 3.39

R 文化、体育和娱乐业 601,035.95 2.57

S 综合 --

合计 19,932,744.89 85.16

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 --

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

75

B 采掘业 --

C 制造业 1,210,713.61 5.17

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 96,989.40 0.41

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 678,653.44 2.90

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 1,986,356.45 8.49

(三) 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 300498 温氏股份 67,519 1,582,645.36 6.76

2 300072 三聚环保 19,811 733,997.55 3.14

3 002466 天齐锂业 13,132 713,724.20 3.05

4 300136 信维通信 17,606 704,592.12 3.01

5 002460 赣锋锂业 11,848 547,970.00 2.34

6 002572 索菲亚 12,453 510,573.00 2.18

7 300156 神雾环保 13,657 447,403.32 1.91

8 002044 美年健康 26,200 445,400.00 1.90

9 300017 网宿科技 31,872 384,695.04 1.64

10 002074 国轩高科 11,773 371,438.15 1.59

(四)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	300104	乐视网	23,696	678,653.44	2.90
2	002252	上海莱士	21,955	444,369.20	1.90
3	002426	胜利精密	40,222	308,904.96	1.32
4	300367	东方网力	10,775	215,500.00	0.92
5	000836	鑫茂科技	25,633	155,079.65	0.66

(五)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

76

本基金本报告期末未持有债券。

(六)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

本基金本报告期末未持有债券。

(七)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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八)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投资贵金属。

(九)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

本基金本报告期末未持有权证。

(十)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

2.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。

(十一)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

(十二)投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本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。

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。

3、期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	988.32
---	-------	--------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

77

4	应收利息	254.27
---	------	--------

5 应收申购款 9,987.02

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 11,229.61

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、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(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。

(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 300104 乐视网 678,653.44 2.90 重大事项

2 002252 上海莱士 444,369.20 1.90 重大事项

3 002426 胜利精密 308,904.96 1.32 重大事项

4 300367 东方网力 215,500.00 0.92 重大事项

5 000836 鑫茂科技 155,079.65 0.66 重大事项

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。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

78

第十三部分 基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

一、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩

基准收益率比较表

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

2012.3.29~2012.12.31 -6.60% 1.19% 3.82% 1.31% -10.42% -0.12%

2013.1.1~2013.12.31 20.61% 1.53% 23.12% 1.51% -2.51% 0.02%

2014.1.1~2014.12.31 -0.36% 1.28% 2.89% 1.28% -3.25% 0.00%

2015.1.1~2015.12.31 67.62% 2.83% 59.15% 2.58% 8.47% 0.25%

2016.1.1~2016.12.31 -19.48% 1.85% -19.30% 1.73% -0.18% 0.12%

2017.1.1~2017.6.30 3.99% 0.82% 6.13% 0.83% -2.14% -0.01%

2012.3.29~2017.6.30 72.13% 1.79% 79.28% 1.70% -7.15% 0.09%

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。

二、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

79

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。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

80

第十四部分 基金的财产

一、基金财产总值

本基金的基金财产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

二、基金财产净值

本基金的基金财产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。

三、基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

四、基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
- 4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

81

第十五部分 基金财产的估值

一、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

三、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

四、估值方法

1、股票估值方法

(1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(3) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

82

且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值：

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价

估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
83

估值。

7、股指期货品种将按照相关规定进行估值。

8、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由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目的核对同时进行。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；

3、中国证监会认定的其他情形。

七、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

本基金作为分级基金，按照诺安稳健份额和诺安进取份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日诺安创业成长份额、诺安稳健和诺安进取份额的基金份额净值：

1、诺安创业成长份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日诺安创业成长份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金， T 日本基金基金份额的总数为诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的份额数之和。

2、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额参考净值计算

$= 1 + R$

t

NAV N

诺安稳健 ()

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

84 10 4

=

6

NAV NAV

NAV

创业成长 诺安稳健

诺安进取

设 T 日为诺安稳健、诺安进取基金份额参考净值计算日， $T=1,2,3,\dots,N$ ；N 为当年实际天数； $t=\min\{\text{自年初至 } T \text{ 日, 自基金合同生效日至 } T \text{ 日, 自最近一次会计年度内份额折算日至 } T \text{ 日}\}$ ；

NAV 创业成长

为 T 日每份诺安创业成长份额的基金份额净值；

NAV 诺安稳健

为 T

日诺安稳健份额的基金份额参考净值；

NAV 诺安进取

为 T 日诺安进取份额的基金份额参考净

值；R 为诺安稳健份额约定年基准收益率。

诺安创业成长份额净值、诺安稳健份额参考净值、诺安进取份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

八、估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位（含第 3 位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额任一类别份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额任一类别份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人及基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

85

第十六部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益和其他收入（含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、收益分配原则

在存续期内，本基金（包括诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止诺安稳健份额与诺安进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

86

第十七部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 6、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金合同生效以后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 9、基金资产的资金汇划费用；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

87

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

3、基金的指数使用费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的的指数使用费年费率为0.02%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用费收取下限为每季度5万元（《基金合同》生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行。

4、本条第一款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

三、不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

88

第十八部分 基金份额折算

一、定期份额折算

在诺安稳健份额、诺安创业成长份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

（一）基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

（二）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺安稳健份额、诺安创业成长份额。

（三）基金份额折算频率

每年折算一次。

（四）基金份额折算方式

诺安稳健份额和诺安进取份额按照基金合同“四、基金份额的分类与净值计算规则”进行参考净值计算，对诺安稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每10份诺安创业成长份额将按4份诺安稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，诺安稳健份额和诺安进取份额的份额配比保持 4: 6 的比例。

对于诺安稳健份额期末的约定应得收益，即诺安稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内诺安创业成长份额分配给诺安稳健份额持有人。诺安创业成长份额持有人持有的每 10 份诺安创业成长份额将按 4 份诺安稳健份额获得新增诺安创业成长份额的分配。持有场外诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外诺安创业成长份额的分配；持有场内诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内诺安创业成长份额的分配。经过上述份额折算，诺安稳健份额和诺安创业成长份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对诺安稳健份额和诺安创业成长份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行诺安稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

89 10 4

=

6

NAV NAV

NAV

创业成长 诺安稳健

诺安进取

1.诺安稳健份额

定期份额折算后诺安稳健份额的份额数 = 定期份额折算前诺安稳健份额的份额数

4

1.000

10 =

NAV NUM NAV NUM

NAV

NUM

前 前 期末 前

创业成长 创业成长 诺安稳健 创业成长 后

创业成长 前

创业成长

- ()

诺安稳健份额持有人新增的场内诺安创业成长份额的份额数 =

NAV 1.000

NUM

NAV

期末

前 诺安稳健

诺安稳健 后

创业成长

其中：

NAV 后

创业成长

：定期份额折算后诺安创业成长份额净值

NAV 前

创业成长

：定期份额折算前诺安创业成长份额净值

NUM 前

诺安稳健

：定期份额折算前诺安稳健份额的份额数

NUM 前

创业成长

：定期份额折算前诺安创业成长份额的份额数

NAV 期末

诺安稳健：每份诺安稳健份额期末参考净值

2.诺安进取份额

每个会计年度的定期份额折算不改变诺安进取份额参考净值及其份额数。

3.诺安创业成长份额

4

1.000

10 =

NAV NUM NAV NUM

NAV

NUM

前 前 期末 前

创业成长 创业成长 诺安稳健 创业成长 后

创业成长 前

创业成长

- ()

诺安创业成长份额持有人新增的诺安创业成长份额=

4 1.000

10

NAV

NUM

NAV

期末

前 诺安稳健

创业成长 后

创业成长

定期份额折算后诺安创业成长份额的份额数 = 定期份额折算前诺安创业成长份额的份
额数 + 诺安创业成长份额持有人新增的诺安创业成长份额的份额数+ 诺安稳健份额持有
人新增的场内诺安创业成长份额的份额数。

其中：

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

90 NAV 后

创业成长

：定期份额折算后诺安创业成长份额净值

NAV 前

创业成长

：定期份额折算前诺安创业成长份额净值

NUM 前

创业成长

：定期份额折算前诺安创业成长份额的份额数

NAV 期末

诺安稳健：每份诺安稳健份额期末参考净值

（五） 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺安稳健份额与诺安进取份额的上市交易和诺安创业成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（六） 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

（七） 特殊情形的处理

若在某一会计年度最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元；当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

（一）当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

1. 基金份额折算基准日

诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2. 基金份额折算对象 基金份额折算基准日登记在册的诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额。

3. 基金份额折算频率

不定期。

4. 基金份额折算方式

当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

91

诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为 4：6，份额折算后诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当诺安创业成长份额的份额净值达到 2.000 元后，诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安

创业成长份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

(1) 诺安稳健份额

份额折算原则：

- 1) 份额折算前诺安稳健份额的份额数与份额折算后诺安稳健份额的份额数相等；
- 2) 诺安稳健份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的参考净值部分全部折算为场内诺安创业成长份额。

$NUM_{后} =$

$NUM_{前}$

$\times \frac{NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$+ \frac{NAV_{前} - NAV_{后}}{NAV_{后}} \times \text{新增场内诺安创业成长份额的份额数}$

$=$

$\frac{NUM_{前} \times NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$+ \frac{NAV_{前} - NAV_{后}}{NAV_{后}} \times \text{新增场内诺安创业成长份额的份额数}$

$NUM_{前} \times \frac{NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$\times \left(\frac{NAV_{前}}{NAV_{后}} \right)$

其中：

$NUM_{前}$

：诺安稳健

：份额折算前诺安稳健份额的份额数

$NUM_{后}$

：诺安稳健

：份额折算后诺安稳健份额的份额数

$NAV_{前}$

：诺安稳健

：份额折算前诺安稳健份额参考净值

(2) 诺安进取份额

份额折算原则：

- 1) 份额折算后诺安进取份额与诺安稳健份额的份额数保持 4:6 配比；
- 2) 份额折算前诺安进取份额的资产净值与份额折算后诺安进取份额的资产净值及新增场内诺安创业成长份额的资产净值之和相等；
- 3) 份额折算前诺安进取的持有人在份额折算后将持有诺安进取份额与新增场内诺安创业成长份额。

$NUM_{后} =$

$NUM_{前}$

$\times \frac{NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$+ \frac{NAV_{前} - NAV_{后}}{NAV_{后}} \times \text{新增场内诺安创业成长份额的份额数}$

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

92

$=$

$\frac{NUM_{前} \times NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$+ \frac{NAV_{前} - NAV_{后}}{NAV_{后}} \times \text{新增场内诺安创业成长份额的份额数}$

$NUM_{前} \times \frac{NAV_{前}}{NAV_{后}}$

$\times \left(\frac{NAV_{前}}{NAV_{后}} \right)$

其中：

NUM 后

诺安进取

: 份额折算后诺安进取份额的份额数

NUM 前

诺安进取

: 份额折算前诺安进取份额的份额数

NAV 前

诺安进取

: 份额折算前诺安进取份额参考净值

(3) 诺安创业成长份额

份额折算原则:

场外诺安创业成长份额持有人份额折算后获得新增场外诺安创业成长份额, 场内诺安创业成长份额持有人份额折算后获得新增场内诺安创业成长份额。

=

1.000

NUM NAV

NUM

前 前

后 创业成长 创业成长

创业成长

其中:

NUM 后

创业成长

: 份额折算后诺安创业成长份额的份额数

NUM 前

创业成长

: 份额折算前诺安创业成长份额的份额数

NAV 前

创业成长

: 份额折算前诺安创业成长份额净值

5.基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺安稳健份额与诺安进取份额的上市交易和诺安创业成长份额的申购或赎回等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6.基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告, 并报中国证监会备案。

(二) 当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元, 本基金将按照以下规则进行份额折算。

1.基金份额折算基准日

诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元, 基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

2.基金份额折算对象 基金份额折算基准日登记在册的诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成长份额。

3.基金份额折算频率
不定期。

4.基金份额折算方式

当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为 4：6，份额折算后诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当诺安进取份额参考净值达到 0.250 元后，诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成长份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

(1) 诺安进取份额

份额折算原则：

份额折算前诺安进取份额的资产净值与份额折算后诺安进取份额的资产净值相等。

=

1.000

NUM NAV

NUM

前 前

后 诺安进取 诺安进取

诺安进取

其中：

NUM 后

诺安进取

：份额折算后诺安进取份额的份额数

NUM 前

诺安进取

：份额折算前诺安进取份额的份额数

NAV 前

诺安进取

：份额折算前诺安进取份额参考净值

(2) 诺安稳健份额 份额折算原则：

1) 份额折算前后诺安稳健份额与诺安进取份额的份额数始终保持 4：6 配比；

2) 份额折算前诺安稳健份额的资产净值与份额折算后诺安稳健份额的资产净值及新增场内诺安创业成长份额的资产净值之和相等；

3) 份额折算前诺安稳健的持有人在份额折算后将持有诺安稳健份额与新增场内诺安创业成长份额。

4

=

6

NUM NUM

后 后

诺安稳健 诺安进取

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

94- 1.000

=

1.000

NUM NAV NUM

NUM

前 前 后

场内 诺安稳健 诺安稳健 诺安稳健

创业成长

其中:

NUM 后

诺安稳健

: 份额折算后诺安稳健份额的份额数

NUM 后

诺安进取

: 份额折算后诺安进取份额的份额数

NUM 场内

创业成长

: 份额折算前诺安稳健份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内诺安

创业成长份额的份额数

NUM 前

诺安稳健

: 份额折算前诺安稳健份额的份额数

NAV 前

诺安稳健

: 份额折算前诺安稳健份额参考净值

(3) 诺安创业成长份额:

份额折算原则:

份额折算前诺安创业成长份额的资产净值与份额折算后诺安创业成长份额的资产净值

相等。

=

1.000

NUM NAV

NUM

前 前

后 创业成长 创业成长

创业成长

其中:

NUM 后

创业成长

: 份额折算后诺安创业成长份额的份额数

NUM 前

创业成长

: 份额折算前诺安创业成长份额的份额数

NAV 前

创业成长

: 份额折算前诺安创业成长份额净值

5.基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停诺安稳健份额与诺安进取份额的上市交易和诺安创业成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6.基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

95

第十九部分 诺安稳健份额与诺安进取份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，诺安稳健份额与诺安进取份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

诺安稳健份额与诺安进取份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，诺安稳健份额、诺安进取份额将全部转换成诺安创业成长份额的场内份额。

1、份额转换基准日

诺安稳健份额与诺安进取份额终止运作日（如该日为非交易日，则顺延至下一个交易日）。

2、份额转换方式

在转换基准日日终，以诺安创业成长份额的基金份额净值为基准，诺安稳健份额、诺安进取份额按照各自的基金份额参考净值转换成诺安创业成长份额的场内份额。

诺安稳健份额（或诺安进取份额）基金份额持有人持有的转换后诺安创业成长份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

诺安稳健份额（或诺安进取份额）的转换比率 = 份额转换基准日诺安稳健份额（或诺安进取份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日诺安创业成长份额的基金份额净值。

诺安稳健份额（或诺安进取份额）基金份额持有人持有的转换后诺安创业成长份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前诺安稳健份额（或诺安进取份额）的份额数 × 诺安稳健份额（或诺安进取份额）的转换比率。

3、份额转换后的基金运作

诺安稳健份额与诺安进取份额全部转换为诺安创业成长份额的场内份额后，本基金仅剩余诺安创业成长份额这一类基金份额。诺安创业成长份额将上市交易，并接受场外与场内申购和赎回。

4、份额转换的公告

诺安稳健份额与诺安进取份额进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

第二十部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法規规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告；
- 3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

第二十一部分 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过至少一种指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

一、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

二、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

三、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

四、《上市交易公告书》

基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将《上市交易公告书》登载在指定媒体上。

五、基金财产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在诺安稳健份额和诺安进取份额两类份额开始上市交易或者诺安创业成长份额开始办理申购赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金财产净值和诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值。

在诺安稳健份额和诺安进取份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他

媒介，披露开放日的诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金财产净值和诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

98

市场交易日的次日，将基金财产净值以及诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

六、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告及更新的招募说明书。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

七、诺安创业成长份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明诺安创业成长份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

八、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

99

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7、基金募集期延长；

8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、诺安创业成长份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、基金开始办理或暂停接受配对转换申请；
- 27、基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28、基金实施基金份额折算；
- 29、诺安稳健份额、诺安进取份额上市交易；
- 30、诺安稳健份额、诺安进取份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 31、基金份额持有人大会的决议；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

100

- 32、中国证监会规定的其他事项。

九、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

十、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

十一、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

101

第二十二部分 风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

- 1、政策风险。因国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。
- 2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。
- 3、利率风险。利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。
- 4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。
- 5、信用风险。基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。
- 6、购买力风险。因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

三、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记结算系统瘫痪、核算系统无法按正常时限诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

102

产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

四、本基金特有风险

1. 指数投资风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为中证创业成长指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

(1) 系统性风险

本基金为股票型基金，重点投资于中证创业成长指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临中证创业成长指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

(2) 投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

(3) 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为

本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资人还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

（4）跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

- ①基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。
 - ②指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。
 - ③当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。
 - ④投资人申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、
- 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

103

摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

⑤在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

⑥其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

（5）标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2.基金运作的特有风险

（1）上市交易风险

诺安稳健与诺安进取份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖诺安稳健份额与诺安进取份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致诺安稳健份额与诺安进取份额产生流动性风险。

（2）杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金，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来看，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。

由于诺安进取份额内含杠杆机制的设计，诺安进取份额参考净值的变动幅度将大于诺安创业成长份额和诺安稳健份额净值的变动幅度，即诺安进取份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

（3）折/溢价交易风险

诺安稳健份额与诺安进取份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将诺安稳健份额和诺安进取份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

104

完全规避该风险的存在。

（4）风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在诺安创业成长份额净值达到 2.000 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原诺安进取份额持有人将会获得一定比例的诺安创业成长份额，因此原诺安进取份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在诺安进取份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原诺安稳健份额持有人将会获得一定比例的诺安创业成长份额，因此，原诺安稳健份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于对诺安稳健份额在会计年度初，把约定收益折算为场内诺安创业成长份额的设计，使原诺安稳健份额持有人将会获得一定比例的诺安创业成长份额，因此，原诺安稳健份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

（5）份额折算风险

①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买诺安稳健份额或诺安进取份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资人赎回基金份额。因此，如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司购买诺安稳健份额或诺安进取份额，在其参与份额折算后，则折算新增的诺安创业成长份额并不能被赎回。此风险需要引起投资人注意，投资人可以选择在份额折算前将诺安稳健份额或诺安进取份额卖出，或者将新增的诺安创业成长份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

（6）份额配对转换业务中存在的风险

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

105

基金合同生效后，在诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理诺安创业成长份额与诺安稳健份额、诺安进取份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变诺安稳健份额和诺安进取份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

（7）基金的收益分配风险

在存续期内，本基金（包括诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额）将不进行收益分配。

在每个会计年度年（除成立当年外）的第一个工作日，基金管理人将根据基金合同的约定对本基金诺安创业成长份额和诺安稳健份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资人可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资人通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资人不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

五、其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生

的风险：

- 2、 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 3、 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 4、 因业务竞争压力可能产生的风险；
- 5、 其他风险。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

106

第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

- 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。
- 2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。
- 3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

二、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

三、基金财产的清算

- 1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员

107

员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的应计分配比例，并据此由诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
108

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
109

第二十四部分 基金合同内容摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：诺安基金管理有限公司

住所：广东省深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

法定代表人：秦维舟

成立日期：2003 年 12 月 9 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

110

规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

- (8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- (10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

- (1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
111

符合基金合同等法律文件的规定；

- (12) 计算并公告基金财产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立日期：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；

发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事

同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

112

险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外

汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行

和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价

证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡

的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵

金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区

的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

2、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
 - (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
 - (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
 - (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；
 - (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
 - (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
 - (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
 - (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
 - (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
 - (10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
 - (11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管
- 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

113

理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核基金管理人计算的基金财产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的

权益。

2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

114

- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

(二) 有以下情形之一的，经基金管理人、基金托管人或者单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、终止诺安稳健份额与诺安进取份额运作；

10、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 有以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率；

2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4、在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，增加新的收费方式；

5、基金推出新业务或服务；

6、基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

7、标的指数更名或调整指数编制方法；

8、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

9、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

10、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四) 召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应

当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。

基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、权益登记日；
- 6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

117

- 1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- 2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- 3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；
- 4、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
- 5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、

诺安进取份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

118

将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合计持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

（八）表决

1、诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

对于特别决议应当经出席会议的诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

（2）一般决议

对于一般决议应当经出席会议的诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

119

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

120

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4. 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十一）法律法规或监管机构对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益和其他收入（含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

在存续期内，本基金（包括诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额）不进行

收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止诺安稳健份额与诺安进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 6、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金合同生效以后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
121

- 9、基金资产的资金汇划费用；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的的指数使用费年费率为 0.02%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用费收取下限为每季度 5 万元（《基金合同》生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。指数使用诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

122

费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行。

4、本条第（一）款第 4 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

123

以将其纳入投资范围。

（二）投资限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

(1) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(2) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证创业成长指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

124

产支持证券合计规模的 10%；

(6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(8) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(9) 本基金在任何交易日日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(10) 法律法规、中国证监会规定的其他投资比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

本基金作为分级基金，按照诺安稳健份额和诺安进取份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额净值：

1. 诺安创业成长份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日诺安创业成长份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

125

安创业成长份额的份额数之和。

2. 诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额参考净值计算

t

$$NAV = 1 + R \cdot N$$

诺安稳健 ()

10 4

=

6

NAV NAV

NAV

创业成长 诺安稳健

诺安进取

设 T 日为基金份额参考净值计算日， $T=1,2,3 \dots N$ ；N 为当年实际天数； $t=\min\{\text{自年初至 } T \text{ 日}, \text{自基金合同生效日至 } T \text{ 日}, \text{自最近一次会计年度内份额折算日至 } T \text{ 日}\}$ ；

NAV 创业成长

为 T 日每份诺安创业成长份额的基金份额净值；

NAV 诺安稳健

为 T 日诺安稳健份

额的基金份额参考净值；

NAV 诺安进取

为 T 日诺安进取份额的基金份额参考净值；R 为诺安稳健份额约定年基准收益率。

诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

3. 本基金的基金合同生效后，在诺安稳健份额和诺安进取份额两类份额开始上市交易或者诺安创业成长份额开始办理申购赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值；

4. 在诺安稳健份额和诺安进取份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。

5.基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值以及诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

126

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

127

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

(4) 对基金财产进行评估和变现；

(5) 制作清算报告；

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的应计分配比例，并据此由诺安创业成长份额、诺安稳健份额与诺安进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理和适用的法律

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

128

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

129

第二十五部分 基金托管协议摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：诺安基金基金管理有限公司

住所：广东省深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

法定代表人：秦维舟

成立时间：2003 年 12 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号

注册资本：人民币 1.5 亿元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

130

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

- 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；
- 2、对基金投融资比例进行监督；
- 3、为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；
- 4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；
- 5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金份额折算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人按安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

131

人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、基金份额折算、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基

金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

132

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二) 基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

(三) 基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

(四) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

(五) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

133

金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(六) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日诺安创业成长份额、诺安稳健份额以及诺安进取份额的基金份额净值，并发送给基诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

134

基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并将复核结果传送给基金管理人，由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目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位（含第 3 位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额任一类别份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额任一类别份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机构对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（二）基金会计核算

1、基金账册的建立

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

135

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

136

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

七、争议的处理和适用的法律

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人 与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
137
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期
138

第二十六部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

一、公开信息披露服务

- 1、披露公司（基金管理人）信息；

- 2、披露基金信息；
- 3、其他信息的披露。

二、对账服务

- 1、对账信息；
- 2、其他资料。

三、查询服务

1、账户信息查询

对于基金管理人所管理基金的基金份额持有人，基金管理人都会给予其唯一的客户服务账户及初始密码。为了持有人方便起见，客户服务账户将和客户基金账户唯一对应。基金份额持有人在客户服务中心和基金管理人网站都可以凭借客户服务账户、基金账户或身份证号进入本人的账户，了解账户信息，包括本人的基本资料、基金品种、基金份额、基金投资收益率等。

2、客户账户信息的修改

基金份额持有人可以直接登陆基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务中心，由服务人员提供相关服务。为了维护客户的利益，客户重要信息的更改由基金份额持有人亲自到指定的基金销售网点进行。

3、信息定制

基金份额持有人可以在基金管理人网站定制自己所需要的信息，包括基金管理人新闻、市场行情、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求将定期或不定期向客户发送信息，客户也可以直接登陆基金管理人网站浏览相关信息。如果客户不需要或需要调整，也可以直接在线修改和调整。

四、基金投资的服务

1、免费红利再投资服务：

2、定期定额计划服务：基金管理人通过直销网上交易平台以及中国工商银行、中国民生诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

139

银行、江苏紫金农商行、渤海证券、华融证券、中国银行、爱建证券、长城证券、长江证券、光大证券、国海证券、国泰君安证券、南京证券、中泰证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、信达证券、中国银河证券、中信建投证券、中信证券、平安证券、大同证券、联储证券、天相投资、蚂蚁基金、众禄基金、好买基金、和讯信息、展恒基金、利得基金、浙江金观城、浙江同花顺、诺亚正行、嘉实财富、唐鼎耀华、凯石财富、泰诚财富、盈米财富、联泰资产、中证金牛、奕丰金融、广源达信、电盈基金、新浪仓石、汇成基金、懒猫金融、肯特瑞、凤凰金信等代销机构为投资者办理定期定额投资业务，具体开放时间和规则请咨询各相关代销机构，也可以拨打本基金管理人客户服务电话进行咨询、或登陆本基金管理人网站查阅相关公告。

五、投诉管理服务

基金管理人的投诉管理由客户服务中心统一管理，设定投诉管理人具体处理投诉，营销服务部负责督促投诉的处理。

诺安基金管理有限公司全国统一客户服务电话：400-888-8998

诺安基金管理有限公司网址：www.lionfund.com.cn

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017年第2期

140

第二十七部分 其他应披露事项

序号 公告事项 法定披露方式 披露日期

1

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2016
年年度报告 基金管理人网站 2017-3-30

2

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2016
年年度报告摘要 《中国证券报》 2017-3-30

3

诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通
银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优
惠的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-4-22

4

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017
年第 1 季度报告 《中国证券报》 2017-4-24

5

诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风
险提示公告 《中国证券报》 2017-4-25

6

诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风
险提示公告 《中国证券报》 2017-4-26

7

诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风
险提示公告 《中国证券报》 2017-4-27

8

诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风
险提示公告 《中国证券报》 2017-4-28

9

诺安基金管理有限公司关于旗下分级基金的风
险提示公告 《中国证券报》 2017-4-29

10

诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计
师事务所的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-4-29

11

诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌
股票省广股份估值调整的公告 《中国证券报》 2017-5-9

12

诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌

股票乐视网估值调整的公告 《中国证券报》 2017-5-12

13

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新) 2017 年第 1 期-正文 基金管理人网站 2017-5-13

14

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新) 2017 年第 1 期-摘要 《中国证券报》 2017-5-13

15

诺安基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-6-8

16

诺安基金管理有限公司关于增加基煜基金为旗下部分基金代销机构并开通转换业务及开展费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-6-15

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

141

17

诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-6-30

18 诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告 基金管理人网站 2017-7-1

19

诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-7-3

20

诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌

股票乐视网估值调整的公告 《中国证券报》 2017-7-12

21

诺安基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及开展费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《中国证券报》 2017-7-18

22

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017年第二季度报告 《中国证券报》 2017-7-20

23

诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华西证券申购及定投申购费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-7-21

24

诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票尔康制药估值调整的公告 《中国证券报》 2017-8-16

25

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017年半年度报告 基金管理人网站 2017-8-28

26

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金 2017年半年度报告摘要 《中国证券报》 2017-8-28

27

诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江南农村商业银行开展的费率优惠活动的公告

《证券时报》、

《上海证券报》、

《中国证券报》

2017-9-11

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

142

第二十八部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书(更新)-2017 年第 2 期

143

第二十九部分 备查文件

一、中国证监会核准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件

二、《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》

三、《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件和营业执照

六、基金托管人业务资格批件和营业执照