

诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺安中证500 交易型开放式指数证券投资基金连接基金基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“基金法”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“运作办法”）的有关规定，以及《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合同》（以下简称“基金合同”）的约定，诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金代码：001351，以下简称“本基金”）的基金管理人诺安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型有关事宜。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决截止时间： 2018 年 12 月 12 日 17 点（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关： 北京市长安公证处

办公地址： 北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦 7 层

联系人： 林永梅

电话：010-65543888-8014

邮政编码：100010

基金管理人咨询电话: 400-888-8998

请在信封表面注明：“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份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案》（详见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案的说明书》（详见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2018 年 11 月 13 日，即在 2018 年 11 月 13 日交易时间结束后，在诺安基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人大会书面通知及通讯表决票将于权益登记日后寄出，未收到表决票的基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.lionfund.com.cn）下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

(2) 个人投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供个人投资者身份证件正反面复印件, 以及填妥的授权委托书原件 (详见附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件 (事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(3) 机构投资者自行投票的, 需在表决票上加盖本单位公章, 并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件 (事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等); 合格境外机构投资者自行投票的, 需在表决票上加盖本机构公章 (如有) 或由授权代表在表决票上签字 (如无公章), 并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件, 该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件, 以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(4) 机构投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件 (事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等), 以及填妥的授权委托书原件 (详见附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件 (事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

合格境外机构投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件, 以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件 (事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

(5) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书, 以基金管理人的认可为准。

3. 基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在前述会议投票表决起止时间内 (以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准) 通过专人送交或邮寄的方式送达至本次持有人大会公证机关的办公地址, 并在信封表面注明: “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份额持有人大会表决专用”。

4. 投资者如有任何疑问, 可致电本基金管理人客户服务电话 400-888-8998 (免长途话费) 咨询。

五、计票

1. 本次通讯会议的计票方式为: 由本基金管理人派出的两名授权代表在基金托管人 (中国银行股份有限公司) 授权代表的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。

2. 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权, 且每份基金份额享有平等的表决权。

3. 表决票效力的认定如下:

(1) 表决票填写完整清晰, 所提供文件符合本会议通知规定, 且在截止时间之前送达指定联系地址的, 为有效表决票; 有效表决票按表决意见计入相应的表决结果, 其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决，计入有效表决票；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

六、会议召开与决议生效条件

1、本基金基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有同等的投票权。

2、基金份额持有人应在表决票(见附件二)上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。

3、基金份额持有人虽提供了符合本会议公告规定的文件，但表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾均视为投票人放弃表决权，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”，其所代表的基金份额仍作为有效票，计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、本基金管理人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告。

5、根据《基金法》、《运作办法》以及《基金合同》约定，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。

6、根据《基金法》、《运作办法》以及《基金合同》约定，本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，决议生效条件为：本次持有人大会所有议案分别经参加大会的基金份额持有人(或其授权代表)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

7、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会完成备案手续之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体公告。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1、召集人：诺安基金管理有限公司

客户服务电话：400-888-8998

传真：0755-83026630

网址：www.lionfund.com.cn

2、托管人：中国银行股份有限公司

注册及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

联系电话：95566

3、公证机关：北京市长安公证处

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦7层

联系人：林永梅

电话：010-65543888-8014

4、见证律师事务所：北京颐合中鸿律师事务所

注册及办公地址：北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1908-1911室

电话：010-65178866

八、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、根据《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及公证费、律师费等相关费用可从基金资产列支。

3、本次基金份额持有人大会不会对本基金的正常申购赎回造成影响，投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回业务。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过诺安基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8998咨询。

5、基金管理人将在基金份额持有人大会召开前连续公布相关提示性公告，就基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

6、本公告的有关内容在法律法规允许范围内由本公司负责解释。

特此公告。

诺安基金管理有限公司

二〇一八年十一月十二日

附件一：《关于诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金修转型有关事宜的议案》

附件二：《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份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《关于诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案的说明书》

附件一：

关于诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案

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份额持有人：

根据市场环境变化，为更好满足投资者需求，保护基金份额持有人利益，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》和《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合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金按照《关于诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案的说明书》（见附件四）提出的方案实施转型。

为实施诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基

金合同》、《诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》等法律文件和和转型方案的有关内容对基金合同、托管协议进行必要的修改和补充。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回或转出。

以上议案，请予审议。

基金管理人：诺安基金管理有限公司

二〇一八年十一月十二日

附件二：

诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称

委托代理人姓名/名称

基金账号

表决事项 表决意见

同意 反对 弃权

关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接

基金转型有关事宜的议案

机构基金份额持有人签章栏

单位公章：

日期：

个人基金份额持有人签字栏

签字：

日期：

说明：

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见。
- 2、以上表决意见是持有人或其受托人就持有人持有的本基金全份额做出的表决意见。
- 3、表决票未填、错填、字迹无法辨认或表决意见无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票。
- 4、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹委托[]先生(女士)或[]单位代表本人(本单位)参加投票截止日为 2018 年 12 月 12 日以通讯方式召开的诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对所有议案的表决权。表决意见以受托人

（代理人）的表决意见为准。本授权不得转授权。若在《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合同》规定的时间内，就同一议案重新召集诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会，除本人（或本单位）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人:_____ (签章/签字)

委托人法定代表人及营业执照注册号(机构投资者):

_____ (签字)

委托人身份证号码(个人投资者):_____

受托人:_____ (签章/签字)

受托人法定代表人及营业执照注册号(机构):

_____ (签字)

受托人身份证号码(个人):_____

委托日期: 二〇一八年[]月[]日

说明:

- 1、页末签字栏中委托人为机构的应当于名称后加盖公章，个人则为本人签字。
- 2、以上授权是持有人就其持有的本基金全份额向受托人所做授权。
- 3、其他签字栏请视情形选择填写，凡适合的栏目均请准确完整填写。
- 4、持有人多次授权，且能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；持有人多次授权，无法区分授权次序的，视为同意其授权的机构之一为受托人。
- 5、授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四:

关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案的说明书

一、声明

诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 6 月 9 日成立并正式运作。根据市场环境变化，为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，提高基金资产的运作效率和基金产品的市场竞争力，诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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》和《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合同》的有关规定,经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事宜的议案》。

本次诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型事宜属原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

本次基金合同修改方案须经参加本次持有人大会的本基金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，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自中国证监会完成备案手续之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。

中国证监会对本次诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金合同修改内容要点

（一）变更基金名称

基金名称由“诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”变更为“诺安中证 500 指数增强型证券投资基金”。

（二）变更基金的类别

基金的类别由“ETF 联接基金”变更为“股票型证券投资基金”。

（三）修改基金的投资范围及投资策略等投资相关条款

对《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合同》中投资范围、投资策略、投资限制等内容进行了调整。

基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪业绩比较基准， 追求跟踪偏离度

及跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金以目标 ETF 基金份额、 标的指数成

份股及备选成份股为主要投资对象。 本基金投

资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值

的 90%， 持有现金或到期日在一年以内的政府

债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现

金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款

等。 此外，为更好地实现投资目标，本基金可少

量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及

其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场

新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货

等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、

次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票

据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、

债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资

产、 以及中国证监会允许基金投资的其他金融

工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

通过投资于目标 ETF，力求以较低的成本获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。

四、投资策略

1、投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还将适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

2、投资管理体制和程序

（1）决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

（2）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

（3）投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

研究支持：指数化投资团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展目标ETF申购赎回清单分析、流动性分析、误差及其归因分析、标的指数成分股分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

投资决策：投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

组合构建：根据标的指数，基金经理构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

交易执行：交易中心负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

投资绩效评估：投资绩效评估：指数化投资团队定期或不定期对基金进行投资绩效评估，以确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

组合维护： 基金经理将跟踪目标 ETF 申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、 基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果， 对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整， 并在 《招募说明书》中列示。

五、投资组合管理

1、构建投资组合

在基金建仓期， 为避免有可能在二级市场造成的价格冲击， 基金经理将主要采取一级市场申购的方式建立联接基金的初始投资组合。

2、日常投资组合管理

（1）基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。

（2）基金经理每日根据本基金申购赎回情况及已有现金滞留，在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。

（3）通常情况下，联接基金的投资组合主要体现为持有目标 ETF 基金份额； 对于目标 ETF 暂停申购、 停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的现金， 基金经理将根据市场情况按照本基金的投资范围约定的其他投资品种进行投资。

3、投资绩效评估

（1）定期对基金的绩效评估进行，主要是对跟踪偏离度进行评估；

（2）指数化投资团队对本基金的运行情况
进行量化评估；

(3) 基金经理根据量化评估报告, 重点分

析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、 现金的控制情况、目标 ETF 的操作等。

在正常市场情况下, 力争控制本基金日均

跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差

不超过 4%。 如因指数编制规则调整或其他因素

导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基

金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟

踪误差进一步扩大。

一、投资目标

本基金为股票指数增强型基金, 在被动跟踪标的指数的基础上, 加入增强

型的积极手段, 力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏

离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 7.75%, 以实现对中证 500 指数

的有效跟踪并力争实现超越, 谋求基金资产的长期增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市

的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包

括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款

(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、

股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具

(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%, 其中投资于中证 500 指数

成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日

终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金持有现金以及

到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不

包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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、投资策略

本基金采用指数化投资作为主要投资策略, 在此基础上进行适度的主动调

整, 在量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏

离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。 为控制基金偏离业绩比较基准的

风险, 本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日均跟踪偏离

度的绝对值不超 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1.资产配置策略

为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于中证 500 指数成分股、备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金将采用复制为主，增强投资为辅的方式，按标的指数的成份股权重建被动组合，通过加入增强型的积极手段，对基金投资组合进行适当调整，以保证本基金投资目标的实现。

2.股票投资策略

本基金被动投资组合采用复制的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下的方法，依靠公司宏观、中观以及微观研究，优先在中证 500 指数成份股中对行业、个股进行超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数中证 500 指数成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

(1)构建被动投资组合

本基金在《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效之日起 6 个月内，将按照中证 500 指数各成分股的基准权重对其逐步买入，在控制好跟踪误差的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重购买某成份股、预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小被动组合相对标的指数的跟踪误差。

(2)构建增强型投资组合

1)基于成分股的增强性投资

在被动投资组合采用复制法复制标的指数的基础上，本基金管理人将通过判断当前国内外宏观经济形势、所处经济周期的阶段，分析经济周期各个阶段不同行业表现的差异以及当前各个行业景气度水平和估值水平，并采用数量化分析与基本面研究相结合的方法，在重点研究的标的指数成份股中选择业绩增长明确、价值被市场低估的品种进行行业和个股的增强性配置。

2) 基于非成分股的增强性投资

a) 替代部分无法投资的标的指数成份股

标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被列入本公司禁止投资股票等因素，导致本基金无法投资该成份股。本基金将首选与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代；若成份股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

b) 前瞻性纳入部分备选成份股

若明确预期标的指数成份股将发生调整，本基金将综合考虑跟踪误差、流动性冲击等因素，在某个限定的时间内，严格按照事先设定的交易计划对相关成份股进行替换。

c) 主动投资潜力较大的非成份股

本基金将依托于公司投研团队自下而上的研究成果，精选数量较少的成份股之外的股票作为增强股票库，在最有把握的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。

3. 债券投资策略

本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析，评定各品种的投资价值，同时着重考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

4. 投资组合调整策略

（1）投资组合调整原则

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最优化。

（2）投资组合调整方法

1) 对标的指数的跟踪调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证 500 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

a) 定期调整

根据中证指数公司按照既定指数编制方法公布的中证 500 指数成分股定期调整结果，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

b) 不定期调整

根据指数编制规则，当中证 500 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司发布的临时调整公告，基

于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

2) 限制性调整

a) 投资比例限制调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，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规定限制时，本基金将对其进行主动性的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

b) 大额赎回调整

当发生大额赎回超过现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

5、跟踪误差控制策略

本基金为控制投资组合相对标的指数的偏离，以“跟踪误差”为指标，控制基金相对标的指数的偏离风险。

本基金以日跟踪误差为测算指标，对投资组合进行监控与评估。其中：

将日跟踪误差的最大容忍值设定为 0.5%（相应折算的年跟踪误差约为 7.75%），以每周为检测周期，即本基金将每周计算该指标，计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当日）。如该指标接近或超过 0.5%，则基金经理必须通过归因分析，找出造成跟踪误差的来源，通过对投资组合进行适当的调整，以使跟踪误差回归到最大容忍值以内。当跟踪误差在最大容忍值以内时，由基金经理对最优跟踪误差的选择作出判断。

当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪误差，具体变化将另行公告。

6. 股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎的原则，参与股指期货的投资，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。

7. 国债期货投资策略

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

8. 权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价

的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

9. 资产支持证券投资策略

本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券 α 策略等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。

基金的投资

六、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不
低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金管理人管理的全部开放式基金
(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基
金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得
超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理
人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行
的可流通股票， 不得超过该上市公司可流通股
票的 30%； 完全按照有关指数的构成比例进行
证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的
特殊投资组合可不受前述关于可流通股票比例
的限制；
- （3） 保持不低于基金资产净值 5%的现金
或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金
不包括结算备付金、 存出保证金、 应收申购款
等；
- （4） 本基金持有一家上市公司的股票，其
市值不超过基金资产净值的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金持有一
家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （6）本基金持有的全部权证，其市值不得
超过基金资产净值的 3%；
- （7）本基金管理人管理的全部基金持有的
同一权证，不得超过该权证的 10%；

(8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 本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%;

(13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

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

(15) 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%;

(16) 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%; 在任何交易日日终, 持有的买入股指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、目标 ETF、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, 本基金未投资股指期货时, 基金持有的有价证券市值比例不受上述限

制；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%； 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%； 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；

（17） 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的， 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

（18） 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的， 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（19） 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（3）、（13）、（17）、（18）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、 股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的， 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。 基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制， 如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则

本基金投资不再受相关限制。

2.目标 ETF 发生相关变更情形时的处理

目标 ETF 出现下述情形之一的， 本基金将在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金， 则本基金将本着维护投资者合法权益的原则， 履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。 相应地， 本基金《基金合同》中将去掉关于目标 ETF 的表述部分， 或将变更标的指数， 届时将由基金管理人另行公告。

(1)目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本

基金的投资策略难以实现；

(2)目标 ETF 终止上市；

(3)目标 ETF 基金合同终止；

(4)目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）。

若目标 ETF 变更标的指数， 本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。 但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的， 本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决， 目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的， 本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益， 基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定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， 但是本基金投资

目标 ETF 或者法律法规、中国证监会另有规定的除外；；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）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；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。

如果指数编制单位变更或停止中证 500 指数的编制、发布或授权，或中证 500 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，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、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

八、风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

九、基金的融资、融券和转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券和转融通业务。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会。

四、投资管理体制及流程

（一）决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本基金基金合同等的相关规定；
- 2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；
- 3、标的指数的编制方法及其变更。

（二）投资决策机制

本基金管理人实行的投资决策机制是：在投资决策委员会授权范围内，投资总监领导下的基金经理负责制。

- 1、投资决策委员会：定期召开会议，负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金经理提出的指数基金建仓方案、维护方案及指数调整期投资组合调整方案；审定基金投资策略报告；决定基金禁止的投资事项等。如遇重大事项，投资决策委员会可召开临时会议做出决策。
- 2、基金经理：负责指数基金投资组合的计划、实施、跟踪、调整和日常管理，负责增强性投资的个股选择等。

3、决策程序

- (1) 研究支持：指数组利用数量模型和风险监测模型，对总体累积偏差、行业偏差以及日跟踪误差进行测算，提供报告；基金经理和分析员从基本面对行业、个股和市场走势提出报告；运营保障部提供基金申购、赎回的动态情况，供基金经理参考；
- (2) 投资决策：投资决策委员会依据上述报告，定期（月）或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进

行基金投资管理的日常决策；

- (3) 组合构建：根据标的指数，结合报告，基金经理以复制标的指数成份股权重的方法构建被动组合，并在控制跟踪误差的前提下，通过增强型投资方法对投资组合进行适当的主动调整；
- (4) 交易执行：交易中心负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责；
- (5) 投资绩效评估：风险控制部定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合；
- (6) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述关于可流通股票比例的限制；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 本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%；

(13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

(15) 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%，在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(16) 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%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(18) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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 95%；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。本基金未投资国债期货、股指期货时，基金持有的有价证券市值比例不受本条款的限制；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。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；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制，届时无需召开基金份额持有人大会。

除上述第(5)、(13)、(20)、(21)项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自《诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》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有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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) 向其基金管理人、基金托管人出资
- (6) 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；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实

际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人将在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

六、业绩比较基准

中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ + 一年期银行储蓄存款利率（税后） $\times 5\%$

中证 500 指数是中证指数有限公司为反映市场上不同规模特征股票的整体表现，以沪深 300 指数为基础，构建的包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系中的组成部分。中证 500 指数全称“中证小盘 500 指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体状况。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

七、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

八、基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基

金份额持有人的利益。

（四）变更基金的收益与分配

对《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合同》中基金的收益与分配等内容进行了调整。如下：

基金的收益与

分配

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配

比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（五）调整基金的费用

对《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合同》中基金的费用等内容进行了调整。如下：

基金的费用与

税收

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

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分

不收取管理费。在通常情况下，基金管理费按前

一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份

额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取

0）的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产

中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部

分；若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月

末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送

基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次

月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给

基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付

日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分

不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前

一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份

额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取

0）的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产

中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部

分；若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月

末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送

基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次

月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若

遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的

1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月

末，按月支付，经基金管理人与基金托管人 核

一致后，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基

金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定

节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的

0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月

末，按月支付，经基金管理人与基金托管人 核

一致后，基金托管人于次月前 2 个工作日内从基

金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日

等,支付日期顺延。

3. 基金指数许可使用费

本基金按照基金管理人与指数许可方所签

订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使

用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可

使用费的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第3—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

变更注册后的诺安中证500指数增强型证券投资基金的申购费、赎回费等费用在《诺安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》中披露。

（六）其他相关事项的修改

删除基金合同中关于基金份额发售与基金备案的部分，并补充基金的历史沿革与存续等内容。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及变更注册后的诺安中证500指数增强型证券投资基金的产品特征、根据基金份额持有人大会决议修订《基金合同》的其他内容及《托管协议》的内容。

此外，本公司将修订后的《诺安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《诺安中证500指数增强型证券投资基金托管协议》以及《诺安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》等文件在指定披露媒介上披露。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）可行性说明

1、基金转型法律可行性

本基金由ETF联接基金转型为股票型指数基金，变更了基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、基金投资组合比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费率等内容，属于基金合同的变更。根据《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合同》第八部分“基金份额持有人大会”一章的规定，变更基金类别、变更基金投资目标、范围或策略等情形应当召开基金份额持有人大会；根据《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合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”一章的规定，基金合同变更涉及前述变更等会对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。因此，本基金管理人认为，本基金转型为股票型指数基金具有法律依据和合同依据。

2、基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，做好了基金运作的相关准备。

3、授权基金管理人修订《基金合同》的可行性

基金管理人将严格按照持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。修订后的《基金合同》需经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会备案。

（二）合规情况说明

1. 本基金托管人中国银行股份有限公司对本次基金转型方案及相关文件出具了无异议的函。
2. 本基金管理人聘请的法律顾问北京颐合中鸿律师事务所为本次转型出具了法律意见书，认为本基金转型方案的内容符合《基金法》、《运作办法》等法律法规和规范性文件的规定以及《基金合同》的约定；转型后本基金符合《基金法》、《运作办法》等法律法规和规范性文件的规定；本基金的转型尚需其基金份额持有人大会审议批准，本次基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会完成备案手续之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体公告。法律法规另有规定的，从其规定。
3. 本基金转型后的基金名称表明了基金的类别。本基金名称不存在损害国家利益、社会公共利益，欺诈、误导投资人，或者其他侵犯他人合法权益的内容。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险,基金管理人有可能按照实际需求，提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对基金转型方案等进行适当的修订。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排，并予以公告。

（二）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为应对转型后遭遇大规模赎回,本基金在转型期间将保证投资组合的流动性，应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

五、基金管理人联系方式

持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

联系人：诺安基金管理有限公司客服中心

电话：400-888-8998

传真：0755-83026677

电子信箱：services@lionfund.com.cn

诺安基金管理有限公司

二〇一八年十一月十二日