

诺安基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同并更新招募说明书的公告

根据中国证监会2021年2月1日生效的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》等法律法规，经与各基金托管人协商一致，诺安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下指数基金《基金合同》的相关条款进行修订，并同步更新招募说明书。

一、本次修订涉及的基金

序号	基金名称	基金主代码
1	诺安中证100指数证券投资基金	320010
2	诺安沪深300指数增强型证券投资基金	320014
3	诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）	163209
4	诺安中证500指数增强型证券投资基金	001351

二、基金合同、招募说明书修订内容

1、在基金合同、招募说明书中新增了标的指数不符合要求、指数编制机构退出等情形时的应急处置安排。

2、在基金合同、招募说明书中新增了当指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整时，基金管理人将对成份股进行调整。

3、在基金合同、招募说明书中揭示了基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险。

4、在招募说明书中列明了指数基金对应标的指数的编制方法及可提供给投资者免费查询指数信息的途径。

三、重要提示

1、此次修订是法律法规或中国证监会的相关规定发生变化需要对旗下指数基金的基金合同进行变更，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，与各基金托管人协商一致并已报监管机构备案。本次修订不涉及原基金份额持有人权利义务关系的变化，对原基金份额持有人的利益无实质性不利影响。

2、修订后的基金合同将于本公告发布之日在本公司网站及中国证监会基金电子披露网站披露。基金合同的具体修订情况可以详见附件各基金的基金合同修订对照表以及修订后的基金合同全文。同时，本公司根据基金合同的修订内容对基金的招募说明书及其摘要进行了同步更新，更新后的招募说明书及其摘要将在本公司网站及中国证监会基金电子披露网站披露。

3、投资者可通过本公司网站及中国证监会基金电子披露网站阅读更新后的基金合同、招募说明书及其摘要。

4、本公司的网站为 www.lionfund.com.cn，客户服务热线为 400-888-8998。

5、中国证监会基金电子披露网站为 <http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

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。

风险提示：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定

盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应仔细阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等产品法律文件及相关公告，充分认识本基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑基金存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售适当性意见的基础上，理性判断并谨慎做出投资决策。

特此公告。

诺安基金管理有限公司
二〇二一年三月二十九日

附件:

1、诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言 和释 义	<p>前言</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范诺安中证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>释义</p> <p>无</p>	<p>前言</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范诺安中证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》</u>（以下简称《<u>指数基金指引</u>》）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>.....</p> <p>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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。</p> <p><u>本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</u></p> <p>释义</p> <p><u>《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p>
第十一部分 基金	<p>四、投资策略</p> <p>2、股票投资组合调整</p> <p>（2）其他因素引起的调整</p>	<p>四、投资策略</p> <p>2、股票投资组合调整</p> <p>（2）其他因素引起的调整</p>

<p>金的投资</p>	<p>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;</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>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。</p> <p>七、标的指数和业绩比较基准 2、如果中证指数有限公司变更或停止中证 100 指数的编制及发布、或中证 100 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中证 100 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。业绩比较基准 中证 100 指数收益率×95%+ 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5% 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出,或者是市场上出现更加适合用于</p>	<p>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;</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>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。</p> <p>⑤其他因素 <u>当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份股替代策略,并对投资组合进行相应调整。</u></p> <p>七、标的指数和业绩比较基准 2、业绩比较基准 中证 100 指数收益率×95%+ 一年期银行储蓄存款利率(税后)×5% 3、未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形的,基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。自指数编制机构停止标的指数的编制及发</p>
--------------------	---	---

	本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在履行适当程序后，变更业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。	布至解决方案确定期间，基金管理人应 <u>按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</u>
第十部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>二、《基金合同》的终止</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>二、《基金合同》的终止</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p><u>3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；</u></p> <p>4、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p><u>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</u></p>

2、诺安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>(以下简称“<u>《指数基金指引》</u>”)和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p>

		<p>本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>无</p>	<p><u>14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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，在数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%。</p> <p>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。</p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>沪深 300 指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p>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出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在履行适当程序后，变更业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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，在数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%。</p> <p>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。</p> <p><u>当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</u></p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>沪深 300 指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p><u>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形的，基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换</u></p>

		<p><u>基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</u></p> <p><u>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</u></p>
第十八部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p><u>3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；</u></p> <p>4、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

3、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——</u></p>

	<p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p>	<p><u>指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</u></p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p> <p><u>本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</u></p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>无</p>	<p><u>14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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，在数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。</p> <p>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。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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，在数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。</p> <p>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。</p> <p><u>当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</u></p>

	<p>五、业绩比较基准</p> <p>创业板指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p>如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布、维护或授权，或标的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标的指数不宜继续作为业绩比较基准组成部分的，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人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>创业板指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p><u>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形的，基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</u></p> <p><u>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</u></p>
<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p><u>3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；</u></p> <p>4、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

4、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容

<p>第一部分前言</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律、法规。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>(以下简称“<u>《指数基金指引》</u>”)和其他有关法律、法规。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。</p> <p><u>本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。</u></p>
<p>第二部分释义</p>	<p>无</p>	<p><u>15、《指数基金指引》:指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p>
<p>第十一部分基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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%。</p> <p>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</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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%。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>中证 500 指数收益率×95%+ 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p>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内小市值公司的整体状况。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p><u>当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</u></p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>中证 500 指数收益率×95%+ 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%</p> <p>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内小市值公司的整体状况。</p> <p><u>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形的，基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</u></p> <p><u>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</u></p>
<p>第十 八部 分基</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p>

<p>金合 同的 变 更、 终 止 与 基 金 财 产 的 清 算</p>	<p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的； 3、《基金合同》约定的其他情形； 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的； <u>3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；</u> 4、《基金合同》约定的其他情形； 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>
---	---	--