诺安基金管理有限公司关于以现场开会方式召开诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

诺安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已于2019年3月26日于《中国证券报》及诺安基金管理有限公司网站（www.lionfund.com.cn）发布了《诺安基金管理有限公司关于以现场开会方式召开诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》的公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

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”）的约定，诺安中证创业成长指数分级证券投资基金（基金代码：163209，以下简称：“本基金”）的基金管理人诺安基金管理有限公司决定以现场开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：现场开会方式

2、会议召开时间：2019年4月25日10点

3、会议召开地点：北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦7层

基金管理人咨询电话：400-888-8998

二、会议审议事项

《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资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《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资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2019年3月27日，即在2019年3月27日交易时间结束后，在中国证券登记结算有限责任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的表决。

四、会议的议事程序和表决

1、大会主持人宣布会议开始；

2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和基金份额持有人代理人人数及其所持有的各基金份额总数、占权益登记日各基金份额总份额的比例；

3、大会主持人宣布议事程序及注意事项；

4、大会主持人确定和公布监票人、公布见证律师、公证机构和公证员姓名；

5、大会主持人宣读议案；

6、享有表决权的与会基金份额持有人和基金份额持有人代理人对议案进行审议，并以记名投票方式进行表决；

7、监票人在基金份额持有人或其代理人表决后立即对投票情况进行清点，公证机关对计票过程予以公证；

8、大会主持人当场公布计票结果；

9、大会公证人发表公证词；

10、大会见证律师就本次会议的召开程序以及基金份额持有人大会形成决议的合法性、合规性发表见证意见。

五、会议出席对象

1、权益登记日在本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司登记在册的诺安中证创业成长指数分级证券投资基金的基金份额持有人或其代理人。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、见证律师。

5、公证机关人员。

六、基金份额持有人出席会议需要提供的文件

1、个人基金份额持有人出席会议需要提供以下文件：

（1）个人基金份额持有人出席会议的，需提交：

本人有效身份证件（包括身份证或其他能够证明其身份的有效证件或证明）原件和正反面复印件；

（2）个人基金份额持有人委托他人出席会议并代理行使表决权的，应按照“七、授权”的规定，提供相关资料。

2、机构基金份额持有人出席会议需要提供以下文件：

（1）机构基金份额持有人出席会议的，需提交：

①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事业单位的有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）；

②代表机构基金份额持有人出席会议的个人有效身份证件原件和正反面复印件；

③授权委托书（出席的受托人非法定代表人的，提供加盖公章和法定代表人签署的授权委托书；出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书）。

（2）机构基金份额持有人委托他人出席本次大会并行使表决权的，还应按照本公告“七、授权”的规定，提供相关资料。

七、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接出席会议外，还可以授权委托他人出席基金份额持有人大会并代为在会议上投票表决。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人代为出席基金份额持有人大会并投票表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人出席会议并代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人以及其他符合法律规定的机构和个人，出席会议并代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加的受托人名单。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过书面方式授权受托人代为出席会议并行使表决权。基金份额持有人向他人授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.lionfund.com）下载等方式获取授权委托书样本。

（1）基金份额持有人进行书面授权所需提供的文件

① 个人基金份额持有人委托他人出席会议并投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（附件三），并提供基金份额持有人的个人有效身份证件正反面复印件。

如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件原件和正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人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事业单位有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

② 机构基金份额持有人委托他人出席会议并投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（附件三），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人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事业单位有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件原件和正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人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事业单位有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

（2）书面授权文件的送交

基金份额持有人授权基金管理人出席会议并行使表决权的，可选择直接送交或邮寄的方式送交书面授权文件，具体如下：

①直接送交

基金份额持有人可将填妥的书面授权文件和所需的相关文件直接送交至基金管理人，具体地址和联系方式为：

地址：北京市朝阳区光华路甲14号诺安大厦9层

联系人：倪俊

联系电话：010-59027910

邮政编码：100020

②邮寄

基金份额持有人可将填妥的书面授权文件和所需的相关文件邮寄至基金管理人，具体地址和联系方式为：

地址：北京市朝阳区光华路甲14号诺安大厦9层

联系人：倪俊

联系电话：010-59027910

邮政编码：100020

请在信封表面注明：“诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

（四）授权时间的确定

基金份额持有人通过书面方式进行授权，授权时间以本基金管理人收到授权委托书的时间为准。

（五）授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额多次以有效书面方式授权的，以最后一次有效书面授权为准；

（2）如受托时间相同或无法确定最后一次授权时间，但授权意思不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种表决意见进行表决。

（3）如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

（六）授权截止时间

本基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为：2019年4月24日。

八、计票

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，主持人在会议开始后，宣布在出席会议的基金份额持有人及代理人中选举两名基金份额持有人代表，与基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表共同担任监票人。

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。

在基金管理人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人拒不配合的，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。

4、计票过程由公证机关予以公证。

九、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利，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（指诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各基金份额）应占权益登记日各类别基金总份额的50%以上（含50%）。

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生效条件为：经参加本次大会的基金份额（指诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各基金份额）持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。

7、本次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表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

十、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要出席大会的各基金份额（指诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各基金份额）持有人或其代理人所代表的基金份额应不少于权益登记日各基金总份额的二分之一以上(含二分之一)。若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例而不能成功召开，基金管理人可以在规定时间以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十一、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：010-66596972

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、本次会议将于2019年4月25日10时召开，届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师、公证机关人员将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件于2019年4月25日9时45 分之前到达会议地点，以便验证入场。会议登记截止时间为2019年4月25日9时45 分。登记截止后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

2、在进行会议现场登记时，需要提供开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的相关证件及（或）其复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的证件，需要分别提供各账户对应的相关证件及（或）其复印件。

3、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。

4、基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人(或代理人)、会务人员、聘任律师和公证机关及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场。对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

5、本基金诺安稳健份额与诺安进取份额的首次停牌时间为《诺安基金管理有限公司关于以现场方式现场方式会召开诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2019年3月26日）开市起至当日10:30；本基金诺安稳健份额与诺安进取份额的第二次停牌时间为基金份额持有人大会召开之日（2019年4月25日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

6、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。

7、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。

8、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

二〇一九年三月二十七日

附件一：《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案》

附件二：《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》（样本）

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案的说明书》

附件一：

关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案

诺安中证创业成长指数分级证券投资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”）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，提议对诺安中证创业成长指数分级证券投资基金按照《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资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。

为实施诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型方案，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《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》、《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》等法律文件和转型方案的有关内容对基金合同、托管协议、招募说明书进行必要的修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在本基金转型实施前，制订转型方案并提前公告；提议授权基金管理人在本基金转型期间暂停基金的申购、赎回、定期定额投资、转换、转托管业务并终止配对转换业务，终止上市并进行基金份额的转换以及其他有关本次基金转型的具体事宜。

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

附件二：

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称			
基金份额持有人证件号码			
委托代理人姓名/名称			
委托代理人证件号码			
基金账户号/证券账户号			
持有份额类别	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
表决事项	表决意见		
	同意	反对	弃权
关于诺安中证创业成长指数分级证券投资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部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、本表决票中“基金账户号”指持有诺安中证创业成长指数分级证券投资基金场外份额的基金账户，“证券账户号”指持有诺安中证创业成长指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的诺安中证创业成长指数分级证券投资基金所有份额。

5、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)参加于2019年4月25日以现场开会方式召开的诺安中证创业成长指数分级证券投资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《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》规定的时间内，就同一议案重新召集诺安中证创业成长指数分级证券投资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：二〇一九年[ ]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部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：

关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案的说明书

一、声明

1、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”或“诺安创业成长份额”）于2012年3月29日成立，诺安稳健份额和诺安进取份额于2012年4月27日起在深圳证券交易所上市交易，诺安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的基金管理人。鉴于目前基金市场需求的变化，为维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》、《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》”）的有关规定，本基金管理人诺安基金管理有限公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以现场开会方式召开基金份额持有人大会，审议《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案》。

本次诺安中证创业成长指数分级证券投资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。

本次基金份额持有人大会需要由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（指诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各基金份额）持有人所代表的基金份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上（含50%）方可召开。同时，本次转型方案需经参加大会的基金份额（指诺安创业成长份额、诺安稳健份额、诺安进取份额各基金份额）持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效，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表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。中国证监会对本次基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次基金合同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、基金转型方案要点及基金合同修改内容要点

（一）变更基金名称

基金名称由“诺安中证创业成长指数分级证券投资基金”变更为“诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）”。

（二）基金代码为“163209”。

（三）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

“诺安中证创业成长指数分级证券投资基金”拟转型为“诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）”，转型后由分级基金转为股票型指数基金，因此不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制。

（四）基金份额的终止上市

本基金份额持有人大会决议生效后，将按照深圳证券交易所业务规则申请诺安稳健份额和诺安进取份额终止上市交易。

（五）转型选择期的相关安排

本基金份额持有人大会决议生效后，本基金将在转型正式实施前安排不少于20个交易日的选择期，以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额将最终将转换为诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）的基金份额。

在选择期期间，由于本基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免本基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

（六）基金份额的转换

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，在新修改的基金合同生效前对诺安创业成长份额以及持有的诺安稳健份额和诺安进取份额进行份额的转换。诺安创业成长份额的场外、场内份额将分别转换为诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）的场外、场内份额；诺安稳健份额和诺安进取份额转换为诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）的场内份额，详见基金管理人届时发布的相关公告。

基金份额净值折算

（1）将诺安稳健份额与诺安进取份额折算成诺安创业成长份额的场内份额

在份额折算基准日日终，以创业成长份额的基金份额净值为基准，按照诺安稳健份额与诺安进取份额各自的基金份额净值折算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折算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），取整后的余额计入基金财产。

份额折算计算公式：

诺安稳健份额（或诺安进取份额）的折算比例＝份额折算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/份额折算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）持有人持有的折算后诺安创业成长份额的场内份额数＝基金份额持有人持有的折算前诺安稳健份额（或诺安进取份额）的份额数×诺安稳健份额（或诺安进取份额）的折算比例

（2）将诺安创业成长份额的场内份额、场外份额的份额净值调整为 1.0000 元（基金份额持有人持有的份额数量相应增减）

份额折算计算公式：

诺安创业成长份额的场内份额（或场外份额）的折算比例＝份额折算基准日诺安创业成长份额的场内份额（或场外份额）基金份额净值/1.0000

折算后诺安创业成长份额的场内份额（或场外份额）的份额数＝基金份额持有人持有的折算前诺安创业成长份额的场内份额（或场外份额）的份额数×诺安创业成长份额的场内份额（或场外份额）的折算比例

基金份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位。诺安创业成长份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，诺安创业成长份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位，由此产生的误差计入基金财产。

除保留位数因素影响外，基金份额的折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

（七）基金合同的生效

本基金份额持有人大会决议生效后，关于《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效及《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》同时失效的时间安排，请详见基金管理人届时发布的相关公告。

（八）变更基金的类别

基金的运作方式由“契约型开放式”变更为“上市契约型开放式”。

（九）修改基金的投资范围、投资策略及业绩比较基准等投资相关条款

对《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金》中投资范围、投资策略、投资限制等内容进行了调整。

	变更注册前	变更注册后
基金的投资		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%，以实现对创业板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（包括主板、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)。 本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于创业板股票或存托凭证及其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，基金金持有现金或到期日在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。 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。 二、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。 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.股票配置策略 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，本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于创业板指数成分股、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构建被动组合，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，优先在创业板指数成份股中对行业、个股进行配置或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数创业板 指数成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动性投资组合。 (1)构建被动投资组合 本基金在《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起6个月内，将按照创业板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跟踪复制的因素时，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 主要通过数量化投资模型，并与基本面研究相结合，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越纯比较基准的投资回报。 1)多因子股票模型 该模型以对影响A股市场的长期因素研究为基础，一定程度上统合前瞻性市场判断，找到可能影响股票回报的因子，利用统计分析建立单个因子与未来超 额之间的回报关系，用精研的因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，筛选出针对不同市场环境和行业的有效因子，在综合评判的基础上，构建优质股票组合。具体的因子包括：估值类因子、成长类因子、盈利类因子、流动性类因子、杠杆类因子、技术类因子，一致预期因子等。该模型会综合获取到的各类信息做出具有一定前瞻性的判断，进行调整各因子类别的具体组成及权重。 2）合理价格成长股票模型 该模型将综合考虑企业的营业收入增长率、净利润增长率等成长性的指标和市净率、市盈率、市销率等价值指标，同时根据相关的市场规模，挖掘成长性高而价值被相对低估的股票。 3）投资组合优化模型 本基金将综合考虑跟踪误差、流动性冲击、预期收益及风险等因素进行投资组合优化。选股范围以成分股为主，同时精选少量的成份股之外的股票作为增强股票库，在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行动量优化配置，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。 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，力争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创业板 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 根据深圳证券信息有限公司按照既定指数编制方法公布的创业板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，当创业板指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据深圳交易所和深圳证券信息有限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，当基金投资组合中被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，本基金将在法律法规和基金合同规定的时限内对其进行被动性卖出调整，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 本基金为指数增强型基金，在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。本基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合的跟踪效果进行预估，并及时对投资组合进行适当的调整，力求将跟踪误差控制在目标范围内。 本基金的风险控制目标是：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%。 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。 在预判市场风险较大时，应用股指期货对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低股票仓位后，在面临市场下跌时择机卖出股指期货合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。 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流动性、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，充分考虑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 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察，分析资产支持证券的发行条款，预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 四、投资限制 1.组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于创业板指数成份股及其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%，完全按照有关指数所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，不得超过该资产支持证券规模的10%； （10）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，其市值不得超过基金资产净值的10%； （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）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