（上接A14版）

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层
法定代表人：钟斐斐
联系人：袁永姣
电话：010-61840688
客户服务电话：4000-618-518
网址：http://danjuanapp.com
(102) 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
(103) 阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
客服电话：95510
网址：http://fund.sinosig.com
(104) 和谐保险销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302
办公地址：北京市朝阳区建外大街6号安邦保险大厦10层
法定代表人：左荣林
联系人：张楠
联系电话：010-85256214
客户服务电话：95569
网址：www.hx-sales.com
(105) 方德保险代理有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号楼神华国华投资大厦7层711
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号楼神华国华投资大厦7层711
法定代表人：林柏均
客服电话：010-64068617
网址：www.fundsure.cn
(106) 北京创金启富基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712
办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座综合楼712
法定代表人：梁蓉
客户服务电话：400-6262-818
网址：www.5irich.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。

二、注册登记机构

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
电话：0755-83026688
传真：0755-83026677

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：北京颐合中鸿律师事务所
住所：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
法定代表人/负责人：付朝晖
电话：010-65178866
传真：010-65180276
经办律师：虞荣方、滑丽蓉

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

第六部分 基金的历史沿革与存续

一、本基金的历史沿革

诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）由诺安中证创业成长指数分级证券投资基金变更而来。诺安中证创业成长指数分级证券投资基金经中国证监会2011年10月25日证监许可【2011】1705号文核准公开募集，基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为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自2012年2月27日至2012年3月23日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认（中国证监会基金部函[2012]198号文），《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金合同》于2012年3月29日起正式生效。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金于2019年4月25日通过现场方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过了《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》，内容包括对诺安中证创业成长指数分级证券投资基金变更基金类别、基金的标的指数、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、收益分配原则、费率水平及修订基金合同等，并同意将基金名称更名为“诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）”，上述基金份额持有人大会决议自决议通过之日起生效并报中国证监会备案。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第七部分 基金份额的上市与交易

一、基金份额的上市交易

基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金可申请在深圳证券交易所上市交易。

二、上市交易的地点

深圳证券交易所。

三、上市交易的时间

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。

基金份额上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在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中的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记系统后，方可上市交易。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则和实施细则及颁布机关对其不时做出的修订执行。

五、上市交易的费用

上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将变更为非上市的证券投资基金，无需召开基金份额持有人大会。基金变更并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人制定并按规定公告。

七、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进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他交易场所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销机构及各场外销售机构的基金销售网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行基金份额的申购与赎回。具体办法由基金管理人或相关销售机构另行公告。

二、申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场，证券、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自《诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起不超过 3个月开始办理申购、赎回等业务，具体业务办理起始时间在相关公告中规定。

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或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“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、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，基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；

4、场外赎回遵循“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；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行；

6、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务；

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，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介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等，在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。因投资人未及时进行查询而造成的后果由其自行承担。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。如因申购、赎回申请未得到登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。

4、在法律法规允许的范围内，登记机构可对上述业务内容进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

五、申购与赎回的限制

1、通过场内申购本基金时，单笔申购的最低金额为50,000元（含申购费）。通过本公司直销中心申购本基金，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）。

2、通过本公司直销中心赎回本基金，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一个网点的基金份额余额少于相应的最低赎回限额时，余额部分的基金份额必须一同赎回。

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、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，

基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

六、申购与赎回的费用

（一）申购费用

本基金在申购时收取申购费用，场外申购费率随申购金额的增加而递减。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。具体费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M＜100万元	1.2%
100万元≤M＜500万元	0.8%
500万元≤M＜1000万元	0.2%
M≥1000万元	1000元/每笔

本基金的申购费用由基金申购人承担，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。

基金份额的场内申购费率由基金销售机构参照场内申购费率执行。

（二）赎回费用

本基金场外和场内赎回费率如下表所示：

持有期限（N）	赎回费率
N＜7日	1.50%
7日≤N＜2年	0.50%
2年≤N＜3年	0.25%
N≥3年	0

从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

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。对持续持有期少于7日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日但少于3年的投资人收取的总额的25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

（三）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）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况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率等相关费率。

（五）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

七、申购和赎回金额的数额和价格

（一）申购份额及余额、赎回金额的处理方式

1、申购份额及余额的处理方式：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，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（二）申购份额

本基金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）

申购费用=申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额 / 申购当日基金份额净值

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例一：假定T日的基金份额净值为1.4500元。四笔申购金额分别为1,000.00元、100万元、500万元和1000万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额（元,a）	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00	10,000,000.00
适用申购费率（b）	1.2%	0.8%	0.2%	–
净申购金额（c=a/（1+b））	988.14	992,063.49	4,990,019.96	9,999,000.00
申购费（d=a-c）	11.86	7,936.51	9,980.04	1,000.00
基金份额净值（e）	1.4500	1.4500	1.4500	1.4500
申购份额（=c/e）	681.47	684,181.72	3,441,393.08	6,895,862.07

（三）赎回金额

基金赎回金额的计算

赎回费 ＝ 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 × 赎回费率

赎回金额 ＝ 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 － 赎回费

例二：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有期限1年，该日基金份额净值为1.350元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000.00×1.350=13,500.00元

赎回费用＝13,500.00×0.5%＝67.50元

净赎回金额=13,500.00-67.50＝13,432.50元

例三：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有期限2年，该日基金份额净值为1.450元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000.00×1.450=14,500.00元

赎回费用＝14,500.00×0.25%＝36.25元

净赎回金额=14,500.00-36.25＝14,463.75元

例五：假定某投资者在T日赎回10,000.00份基金份额，持有3年，该日基金份额净值为1.625元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.625=16,250.00元

（四）基金份额资产净值的计算公式

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4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。具体计算公式为：

基金份额净值 ＝ 基金资产净值 / 基金份额总份数

八、申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并必须依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

九、拒绝或暂停接受申购的情况及处理方式

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券、期货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。

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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、登记结算系统、证券登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

10、申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、7、8、10、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。当发生上述第9项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。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。

十、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、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。

3、证券、期货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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、基金管理人认为继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致无法办理赎回业务。

8、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暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。对于场内赎回申请，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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公告。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站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及基金管理人网站上公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，对于场外赎回申请基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分顺延赎回或暂停办理。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期予以办理。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基金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。部分延期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及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的30%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出30%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有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基金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。具体见相关公告。

（4）暂停赎回：连续2日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；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，并应当在指定媒介上进行公告。

3、当发生上述巨额赎回并延期办理时，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，同时在指定媒介上刊登公告。

十二、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，基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十三、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金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本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、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登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，包括系统内转托管和跨系统转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

1、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登记结算系统内不同销售机构之间进行转托管的行为或在证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场外赎回的销售机构时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回或交易的会员单位时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

（2）本基金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。

十六、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另行规定。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。

十七、基金的冻结和解冻

基金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一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

十八、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

第九部分 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、通知存款等）、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%。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.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，本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例不低于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净值的比例不低于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，构建主动型投资组合。

(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国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

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，力争实现超越业绩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，一定程度上结合前瞻性市场判断，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。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，适时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预期，找出成长性高而价值被相对低估的股票组合。

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 。

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