诺安基金管理有限公司关于以通讯方式召开诺安中小板等权重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2015年1月26日在《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《关于以通讯方式召开诺安中小板等权重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《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》(以下简称“基金合同”)的约定,诺安中小板等权重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”)的基金管理人诺安基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议本基金转型方案等相关事宜。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:2015年2月26日17:00(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:北京市方正公证处

办公地址:北京市西城区西环广场塔3楼1113室

联系人:王顺心 张炜玮

电话:010-58073628

邮政编码:100044

基金管理人咨询电话:400-888-8998

请在信封表面注明:“诺安中小板等权重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

审议《关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》(详见附件一)。

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2015年1月27日,即在2015年1月27日深圳证券交易所交易结束后,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、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)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;

(3)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);

(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)。

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,并请在信封表面注明:“诺安中小板等权重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(交通银行股份有限公司)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、会议召开的条件

1、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;

2、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50%以上(含50%);

未能满足上述条件的情况下,则基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

七、会议认证条件

1、本基金基金份额持有人所持有的每一份基金份额享有一票表决权。

2、本次议案按特别决议处理,经参加本次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通过方为有效。

3、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定的事项自基金份额持有人大会决议通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。

八、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:0755-83026677

网址:www.lionfund.com.cn

2、托管人:交通银行股份有限公司

3、公证机关:北京市方正公证处

4、见证律师事务所:北京顾合中鸿律师事务所

九、重要提示

1. 关于本次议案的说明见附件四《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》。

2. 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。

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、本通知的有关内容由诺安基金管理有限公司负责解释。

特此公告。

诺安基金管理有限公司

二〇一五年二月三日

附件一:《关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》

附件二:《诺安中小板等权重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通讯表决票》

附件三:《授权委托书》

附件四:《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》

附件一:

关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案

诺安中小板等权重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2012年12月10日成立,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,提高产品的市场竞争力,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《中小板等权重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,基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,提议对诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金按照《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》(见附件四)提出的方案实施转型。

为实施诺安中小板等权重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诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式,根据现实有效的法律法规的要求和《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》的内容对《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》等法律文件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

2015年1月26日

附件二:

诺安中小板等权重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
关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案			
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愿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2015年2月26日以通讯方式召开的诺安中小板等权重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。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。本授权不得转授权。

委托人:_____(签章)

委托人法定代表人(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)

受托人法定代表人(机构):_____(签字)

受托人身份证号码(个人):_____

委托日期:二〇一五年[ ]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:

诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书

诺安中小板等权重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2012年12月10日成立,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,提高产品的市场竞争力,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》、《诺安中小板等权重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,本基金管理人诺安基金管理有限公司经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,决定召开基金份额持有人大会,讨论关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案。

本次转型方案需经参加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通过方为有效,存在无法获得持有人大会表决通过的可能。中国证监会对本次基金转型方案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。

一、基金转型的方案要点

(一)变更基金名称

基金名称由“诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金”变更为“诺安研究精选股票型证券投资基金”。

(二)变更基金类别

基金类别由“ETF联接基金”变更为“股票型证券投资基金”

(三)基金投资调整

诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型后,投资目标、投资范围、投资策略等条款调整如下:

1、投资目标

本基金通过深入研究挖掘具有长期发展潜力的行业和上市公司,分享其在中国经济增长的大背景下的可持续性增长,力争实现基金资产的长期稳定增值。

2、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发行并上市的股票)、国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券(含分离交易可转债)、央票、中期票据、资产支持证券、短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具,权证、股指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)。

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。

基金的投资组合比例为:本基金对股票的投资比例不低于基金资产的80%,权证投资比例不得超过基金资产净值的3%,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,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3、投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将科学、规范的选股方法与积极主动的投资风格相结合,采用“自下而上”精选个股策略,同时辅以“自上而下”资产配置和行业配置策略,在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

(1)大类资产配置策略

本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略,根据市场环境的变化,在长期资产配置保持稳定的前提下,积极进行短期资产灵活配置,力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。

本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化,动态优化投资组合,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

(2)股票投资策略

本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和决策机制,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。

1)行业配置

基于研究团队对行业短中长期的评估和判断,确定行业配置的比例。各行业研究员对所负责行业提供超配、标配、低配的配置建议,基金经理根据研究员建议确定和调整各行业资产配置比例。

2)个股精选

在个股精选中,本基金将以价值为本、兼顾成长,将定性分析与定量分析相结合、静态指标与动态指标相结合,注重自下而上的个股筛选,甄别出未来具备成长性且安全边际较高的个股作为投资对象。

3)优化调整

本基金将持续跟踪上市公司和所在行业的基本面情况,结合行业配置比例和个股估值水平、定期和不定期地进行行业、个股的优化配置,定期调整是指按月度和季度对投资组合进行调整,不定期调整是指市场或公司出现重大事件、突发事件、重大观点转变时对投资组合进行的调整。

(3)债券投资策略

本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究,结合新券发行情况,综合分析市场利率和信用利差的变动趋势,采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略,把握债券市场投资机会,以获取稳健的投资收益。

(4)资产支持证券投资策略

包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

(5)权证投资策略

本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具,我们将结合自身资产状况审慎投资,力图获得最佳风险调整收益。

(6)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

4、投资限制

(1)组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1)本基金对股票的投资比例不低于基金资产的80%;

2)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,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;

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)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%;

6)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%;

7)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%;

8)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%;

9)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%,中国证监会规定的特殊品种除外;

10)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%;

11)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%;

12)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;

13)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;

14)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%;

15)流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》(证监基金字[2006]141号)及相关规定执行;

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%;

17)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本条款的限制;

18)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%;

19)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)应当符合修订后的《基金合同》关于股票投资比例的有关约定;

20)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%;

21)基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十;

22)法律法规及中国证监会规定的和修订后的《基金合同》约定的其他投资限制。

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修订后的《基金合同》约定的投资比例规定的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整。

基金管理人应当自修订后的《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修订后的《基金合同》的有关约定,期间,基金的投资范围、投资策略应当符合修订后的《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修订后的《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,且适用于本基金,则本基金在履行适当程序后不再受相关限制,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。

(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,但是中国证监会另有规定的除外;

5)向基金管理人、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。

(3)关联交易

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,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、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深300指数与中证全债指数的混合指数,即:

90%×沪深300指数+10%×中证全债指数

沪深300指数为中证指数公司于2005年4月8日发布的综合反映沪深证券市场整体状况的指数,指数基期为2004年12月31日,基点为1000点。其选样方法是对样本空间股票在最近一年(新股为上市以来)的日均成交金额由高到低排名,剔除排名后50%的股票,然后对剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名,选取排名在前300名的股票作为样本股。

同时,中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

6、风险收益特征

本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

(五)基金费率结构调整

1、基金管理人的管理费变更为:

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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,基金托管人与基金管理人核对一致后于次月前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变更为:

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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,基金托管人与基金管理人核对一致后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的申购费率变更为:

申购金额(含申购费)	申购费率
M<100万元	1.5%
100万元≤M<200万元	1.0%
200万元≤M<500万元	0.6%
M≥500万元	每笔1000元

4、基金的赎回费率变更为:

持有基金份额期限	赎回费率
T<7日	1.5%
7≤T<30日	0.75%
30日≤T<1年	0.5%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0

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。对持续持有本基金少于7日(不含7日)的投资人收取不低于1.5%的赎回费,对持续持有本基金不少于7日但少于30日(不含30日)的投资人收取不低于0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有本基金不少于30日但少于3个月(不含3个月)的投资人收取不低于0.5%的赎回费,并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有本基金不少于3个月但少于6个月(不含6个月)的投资人收取不低于0.25%的赎回费,并将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

(六)变更转型后基金的估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,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;

(3)交易所上市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,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,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,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)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估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国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。

4、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。

5、股指期货合约,以估值日结算价估值;估值日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

(七)变更基金的收益分配相关内容

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4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若修订后的《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日(具体以届时的基金分红公告为准)的基金份额净值转为基金份额;

3、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;

4、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。

5、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

6、若修订后的《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;

7、基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

8、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(八)增加基金的合并条款

自2013年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》第七十九条规定:“按照基金合同的约定或者基金份额持有人大会的决议,基金可以转换运作方式或者与其他基金合并”,本基金增加基金合并的相关内容如下,并相应调整其它相关条款:

(1)基金合并

本基金与其他基金合并,应当按照法律法规规定的程序进行。

二、授权基金管理人修订《基金合同》

首先,除依据上述“一、方案要点”修改《基金合同》以外,基金管理人需要根据转型后的基金产品特征,修订《基金合同》的相关内容。

其次,考虑到自《基金合同》生效以来,《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》及其实施准则等法律法规相继颁布和实施,基金管理人需要根据法律法规要求修订《基金合同》的相关内容。

因此,基金管理人提请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订《基金合同》的内容,修订后的《基金合同》在经基金托管人审核同意后,报中国证监会备案。

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,属于基金合同的变更。根据《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》第八章“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《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》第十九章“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”一章的规定,“基金合同变更涉及本基金合同第八节第(二)项规定的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”。对于变更基金类别、变更基金投资、基金费率等事项,应当召开基金份额持有人大会。因此,本基金管理人认为,本基金转型为股票型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. 本基金托管人交通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顾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定的事项自基金份额持有人大会决议通过之日起生效。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,基金管理人将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,并于以公告。

(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

证券代码:600039 证券简称:四川路桥 公告编号:2015-003

四川路桥建设股份有限公司关于股东权益变动的提示性公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示:

本次权益变动属于减持,不触及要约收购

本次权益变动不会使公司控股股东及实际控制人发生变化

一、本次权益变动基本情况

四川路桥建设股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年1月30日收到四川产业振兴发展投资基金有限公司(以下简称“振兴基金”)通知,振兴基金于2014年12月17日至2015年1月30日累计通过上海证券交易所交易系统减持公司流通股份140,836,800股,减持比例为公司总股本的4.66%。其中,通过上海证券交易所竞价交易系统减持公司流通股份50,836,800股,占公司总股本的1.68%,成交价格区间为5.51元/股~6.06元/股;通过上海证券交易所大宗交易系统减持公司流通股份90,000,000股,占公司总股本的2.98%,成交价格区间为5.27元/股~5.68元/股。

本次权益变动前,振兴基金持有公司股份278,400,000股,占公司总股本的比例为9.22%,为限售流通股,于2014年12月17日解禁。

本次权益变动后,振兴基金持有公司股份137,563,200股,占公司总股本的比例为4.56%,为无限售流通股。

二、所涉及后续事项

本次减持符合《上市公司收购管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》等相关规定;本次权益变动不会导致公司控股股东、实际控制人发生变化。本次权益变动后,四川产业振兴发展投资基金有限公司不再是持有公司5%以上股份的股东。

公司根据《上市公司收购管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》等相关规定,及时履行信息披露义务。

三、备查文件

《四川路桥建设股份有限公司简式权益变动报告书》(减持)

特此公告。

四川路桥建设股份有限公司董事会

2015年2月3日

证券代码:600039 股票简称:四川路桥

四川路桥建设股份有限公司简式权益变动报告书

上市公司名称:四川路桥建设股份有限公司

股票上市地:上海证券交易所

股票简称:四川路桥

股票代码:600039

信息披露义务人:四川产业振兴发展投资基金有限公司

住所:成都高新区交子大道177号1栋2单元8