# 诺安基金管理有限公司中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

## 基金管理人:诺安基金管理有限公司
## 基金托管人:交通银行股份有限公司

**重要提示**

(一)本次基金募集的核准文件名称为:《关于核准中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可【2012】1065号),核准日期为:2012年8月7日。

(二)基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三)投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。

本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

**第一部分 绪 言**

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等有关法律、法规及《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")编写。

本招募说明书的内容涵盖中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的投资目标、投资理念、投资策略、风险以及认购、申购和赎回的程序及费率等与投资本基金有关的所有相关事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书,并注意基金管理人对本招募说明书披露的更新信息。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的《基金合同》编写,并经中国证监会核准。《基金合同》是约定《基金合同》当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

**第二部分 释义**

本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

| | |
|---|---|
| 基金或本基金: | 指中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金; |
| 基金合同: | 指《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充; |
| 招募说明书: | 指《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新; |
| 托管协议: | 指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充; |
| 发售公告: | 指《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》; |
| 中国: | 指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区); |
| 中国证监会: | 指中国证券监督管理委员会; |
| 中国银监会: | 指中国银行业监督管理委员会; |
| 《基金法》: | 指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时做出的修订; |
| 《运作办法》: | 指中国证监会2004年6月29日颁布,同年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》; |
| 《销售办法》: | 指中国证监会2011年6月9日颁布,同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》; |
| 《信息披露办法》: | 指中国证监会2004年6月8日颁布,同年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》; |
| 深交所《业务细则》 | 指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本; |
| 交易型开放式指数证券投资基金 | 指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金",即是指经依法募集的,以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金,其基金份额用组合证券进行申购、赎回,并在深圳证券交易所上市交易; |
| ETF联接基金 | 将绝大多数基金财产投资于本基金,为本基金的投资目标类似,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金; |
| 元: | 指人民币元; |
| 基金合同当事人: | 指受本基金合同约束,根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人; |
| 基金管理人: | 指诺安基金管理有限公司; |
| 基金托管人: | 指交通银行股份有限公司; |
| 基金份额持有人: | 指依照法律法规、招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资人; |
| 登记结算业务 | 《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》包括对该文件不时修改或更新的版本 定义的基金份额的登记、托管和结算业务; |
| 登记结算机构 | 办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司; |
| 投资人: | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者; |
| 个人投资者: | 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人; |
| 机构投资者: | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织; |
| 合格境外机构投资者: | 指符合法律法规规定,经中国证监会批准可以投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局颁发批准的中国境外的机构投资者; |
| 基金募集期: | 指基金合同和招募说明书中载明,并经中国证监会核准的基金份额募集期限,自基金份额发售之日起最长不超过3个月; |
| 基金合同生效日: | 指基金募集达到法律法规规定及《基金合同》约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理备案手续后,中国证监会的书面确认之日; |
| 存续期: | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限; |
| 工作日: | 深圳证券交易所的正常交易日; |
| 发售 | 在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为; |
| 认购: | 在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为; |
| 申购: | 在本基金存续期内,基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人购买基金份额的行为; |
| 赎回: | 在本基金存续期内,基金投资者根据基金销售网点规定的手续,申请将其持有的本基金基金份额兑换为《基金合同》约定的对价资产; |
| 申购赎回清单 | 由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件; |
| 申购对价 | 投资者申购基金份额时,按《基金合同》和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价; |
| 赎回对价 | 基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按《基金合同》和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价; |
| 标的指数 | 中小板等权重指数及其未来可能发生的变更; |
| 组合证券 | 本基金标的指数所包含的全部或部分证券; |
| 完全复制法 | 一种检建跟踪指数的投资组合的方法,通过购买标的指数中的所有成份证券,并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例,以达到复制指数的目的; |
| 最小申购赎回单位 | 本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍; |
| 现金替代 | 申购或赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金; |
| 现金差额 | 最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位应对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算; |
| 预估现金部分 | 由基金管理人计算并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值,预估现金部分由申购赎回代理券商预先垫结; |
| 基金份额参考净值 | 深圳证券交易所在交易时间内根据申购赎回清单中的组合证券的实时市值并加计含预估现金部分所计算发布的基金份额参考净值,简称:IOPV; |
| 指令 | 基金管理人在管理基金资产时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令; |
| 收益评价日 | 基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日; |
| 基金净值增长率 | 收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(即同如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算); |
| 标的指数同期增长率 | 收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(即同如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算); |
| 代销机构: | 指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构; |
| 销售机构: | 指基金管理人及本基金代销机构; |
| 基金销售网点: | 指基金管理人的理财咨询中心及基金代销机构的代销网点; |
| 指定媒体: | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站; |
| 开放日: | 指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期; |
| T日: | 指销售机构在规定时间内受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期; |
| T+n日: | 指T日起(不包括T日)的第n个工作日; |
| 基金收益: | 指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息和其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本或费用的节约; |
| 基金资产总值: | 基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和; |
| 基金资产净值: | 指基金资产总值减去基金负债后的价值; |
| 基金份额净值: | 指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值; |
| 基金资产估值: | 指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程; |
| 法律法规: | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充; |
| 不可抗力: | 指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用及政府、证券监管机构、证券交易所、结算机构、登记机构、证券业自律组织、证券交易场所非正常暂停或停止交易以及其他突发事件。 |

**第三部分 基金管理人**

一、基金管理人概况

公司名称: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
设立日期:2003年12月9日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]132号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元人民币
存续期限:持续经营
电话:0755-83026688
传真:0755-83026677
联系人:陈阳
股权结构:

| 股东单位 | 出资额(万元) | 出资比例 |
|---|---|---|
| 中国对外经济贸易信托投资有限公司 | 6000 | 40% |
| 深圳市捷隆投资有限公司 | 6000 | 40% |
| 大恒新纪元科技股份有限公司 | 3000 | 20% |
| 合 计 | 15000 | 100% |

二、证券投资基金管理情况

截至2012年10月31日,本基金管理人共管理二十一只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金、诺安球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金。

三、主要人员情况

1.董事会成员

秦维舟先生,董事长,工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理,香港昌维发展有限公司总经理,香港先锋投资有限公司总经理,中国新纪元有限公司副总裁,诺安基金管理有限公司副董事长。

杨自理先生,副董事长,工商管理硕士。历任中国中化集团资产管理部经理助理,中国对外经济贸易信托有限公司总经理助理、副总经理、总经理。

张家林先生,董事,高级工程师,全国人民政治协商会议第9、10、11届委员。曾任中科院自动化研究所工程师、高级工程师,中国自动化技术公司总经理。现任中国大恒(集团)有限公司董事长、大恒新纪元科技股份有限公司董事长。

欧阳文安先生,独立董事,工程师。历任中共北京市委副秘书长兼办公厅主任,中共北京市石景山区委书记,中共北京市委常委、秘书长,北京国际电气工程公司董事长,北京国际电力开发投资公司董事长。

朱秉刚先生,独立董事,教授级高级经济师。历任石油部计划司副司长,中国石油天然气集团公司计划局局长、咨询中心副主任。

陆南屏先生,独立董事。历任新华社香港分社办公厅综合处处长、办公厅副主任、国际问题研究中心办公室主任,国家外汇管理局办公室主任、政策法规司司长、副局长。

2.监事会成员

窦捷,经济学硕士,历任中国机械进出口总公司部门经理,联合证券投行部项目经理,中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

赵星明先生,监事,金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长,深圳证券交易所理事会秘书长,君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生,监事。历任浙江证券深圳营业部交易主管,国泰君安证券公司部门主管,诺安基金管理有限公司中央交易室主管。

3.经理层成员

奥成文先生,总经理,经济学硕士,经济师,曾任中国通用技术(集团)控股有限责任公司资产经营部副经理,中国对外经济贸易信托投资有限公司投资银行部副总经理。2002年10月开始参加诺安基金管理有限公司筹备工作,任公司督察长,现任公司总经理。

杨文先生,副总经理,企业管理学博士,曾任国泰君安证券公司研究所金融工程研究员,中融基金管理公司市场部经理。2003年8月加入诺安基金管理有限公司,历任市场部总监、发展战略部总监,现任公司副总经理。

杨谷先生,副总经理,经济学硕士,CFA,曾任平安证券公司综合研究所研究员,西北证券公司资产管理部研究员。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监、诺安股票证券投资基金基金经理、诺安主题精选股票型证券投资基金基金经理。

陈勇先生,督察长,经济学硕士,曾任国泰君安证券公司固定收益部业务董事、资产管理部基金经理,民生证券公司证券投资总部副总经理。2003年10月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、研究部总监,现任公司督察长。

4.基金经理

宋德舜先生,经济学博士,具有证券从业资格,曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理,奉达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010年4月加入诺安基金管理有限公司,现任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,拟任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金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基金经理。

5.投资决策委员会成员的姓名及职务

投资决策委员会由五名成员构成,委员会主席由公司总经理奥成文先生担任,委员包括:杨谷先生,副总经理、投资总监,基金经理;邹翔先生,成长基金组投资总监、基金经理;王剑练先生,研究部总监;王永宏先生,金融工程部副总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

四、基金管理人的职责

1.基金管理人的权利

(1)依法募集基金,办理基金备案手续;
(2)自基金合同生效之日起,依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;
(3)根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
(4)根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(5)在符合有关法律法规和基金合同的前提下,决定本基金的相关费率结构和收费方式;
(6)根据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益的分配方案;
(7)根据法律法规和基金合同的规定,决定基金份额持有人大会;
(8)根据基金合同的规定选择适当的基金销售机构并有权依照销售协议对基金销售机构行为进行必要的监督和检查;
(9)自行办理基金登记结算或选择、更换基金登记结算代理机构,办理基金登记结算业务,并按照基金合同规定对基金登记结算代理机构进行必要的监督和检查;
(10)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;
(11)在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券;
(12)依据法律法规和基金合同的规定,决定不基金的相关费率结构和收费方式;
(13)按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利;
(14)在基金托管人职责终止时,提名新的基金管理人;
(15)依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
(16)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(17)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;
(18)法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

2.基金管理人的义务

(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务;
(6)配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的登记结算或委托其他机构代理该项业务;
(7)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立,对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账,进行证券投资;
(8)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金财产;
(9)按规定保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(10)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
(11)按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
(12)保守基金商业秘密。除《基法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;
(13)按基金合同确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请,及时、足额支付投资者申购的基金份额或赎回的对价;
(15)不谋求对上市公司的控股和直接管理;
(16)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会,或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(17)按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于15年;
(18)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
(19)编制季度、半年度和年度基金报告;
(20)确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料,能在规定时间内发出;保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(21)组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(22)面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(23)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(24)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(25)不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;
(26)公平对待所管理的不同基金和受托资产,防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配;
(27)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(28)基金合同规定的其他义务。

五、基金管理人的承诺

1.基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

2.基金管理人承诺不从事以下禁止性行为:

(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为及基金合同禁止的行为。

3.基金经理承诺

(1)依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;
(3)不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(4)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

1.风险管理及内部控制制度概述

公司风险管理及内部控制是公司为有效防范和控制经营风险和基金资产运作风险,保证公司规范经营、稳健运作,确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整,及时维护公司的良好声誉及股东合法利益,在充分考虑内外部环境因素的基础上,通过构建科学的组织机制、运用有效的管理方法、实施严格的操作程序与控制措施而形成的控制风险的管理系统。

公司风险管理及内部控制的总体目标在于建立一个决策科学、运营规范、管理高效、持续健康发展的资产管理实体,在充分保障基金份额持有人利益的基础上,维护公司的良好声誉及公司股东的合法权益。

2.风险管理制度

(1)风险管理的具体目标

根据国家相关法律法规及公司内部控制大纲的具体要求,公司风险管理的总体目标为:

1)确保国家法律法规、行业规章和公司各项管理规章制度的贯彻执行;
2)建立符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;
3)不断提高基金管理的效率和效益,在有效控制风险的前提下,努力实现基金份额持有人经风险调整后的利益最大化;
4)通过严格的风险控制体系和管理措施,保障公司发展战略的顺利实施和经营目标的全面实现,维护公司及公司股东的合法权益;
5)建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度,及时查错防弊、堵塞漏洞,保证各项业务稳健运行;
6)借鉴和引用国际上成熟、先进的风险控制理念和技术,不断提升公司国际化经营水准和核心竞争能力,巩固公司的声誉和市场份额。

(2)风险管理的原则

公司的风险管理严格遵循以下原则:

1)首要性原则:公司经营管理层将始终把风险管理置于公司经营中的战略层面并作为首要任务;
2)全面性原则:风险管理制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;
3)审慎性原则:公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;
4)独立性原则:合规审查与风险控制委员会、风险控制办公会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性;
5)有效性原则:风险管理制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,并成为所有员工严格遵守的行动指南;
6)适时性原则:风险控制制度的制订应当具有前瞻性。同时,随时对各项制度进行适时的更新、补充和调整,使其适应基金业的发展趋势和最新法律法规的要求;
7)防火墙原则:公司各业务部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

(3)风险管理的具体内容

1)确立加强风险控制的指导思想,以及风险控制的目标和原则;
2)建立层次分明、权责明确、涵盖全面的风险控制体系;
3)建立定性和定量相结合的风险控制方法;
4)建立严格合理的风险控制程序和措施;

5)制定持续有效的风险控制制度的评价和检查机制。

(4)风险管理的体系

1)依据风险管理的具体目标与原则,公司设立了以下风险管理机构及职能部门:

a.董事会下设合规审查与风险控制委员会,负责对公司经营管理和基金投资管理中的合法、合规性进行全面、重点检查分析评价,对公司经营和基金投资管理中的风险进行合规检查和风险控制评估。并出具相应的工作报告和专业意见提交董事会。

b.公司设督察长。督察长对董事会负责,按照中国证监会的规定和督察长的职责进行工作。

c.公司设风险控制办公会,在总经理的领导下制定公司风险管理制度和政策,对金融工程部提交的风险评估报告作出全面的讨论和决定,从而使风险政策得到有力的执行。

d.公司设监察稽核部,监察稽核部直接对总经理负责,同时协助督察长开展工作。监察稽核部在各部门自我监察的基础上依照所规定的职责权限、工作程序进行独立的再监督工作,对公司经营的法律法规风险进行管理和监察,与公司各部门保持相对独立的关系。

e.金融工程部,负责根据公司各类业务的特点和需求,制定各个风险领域(投资、运作、信用等)的风险管理和绩效评估方法,并监督其执行;定期向管理层提交风险评估报告。

2)为最大限度地实现风险管理的目标,公司以上述机构及职能部门为依托,构建了科学严密、层次分明的风险管理体系,主要分为三个层面:

a.第一层面为董事会、合规审查与风险控制委员会;
b.第二层面为总经理、督察长、风险控制办公会及监察稽核部、金融工程部;
c.第三层面为公司各业务相关部门,对各自部门的风险控制负责。

d.公司各风险管理机构及职能部门在上述三个层面上协同运作,建立了严密的风险控制防线,能及时有效地发现、识别、防范及化解公司运营中存在的各种不同类型风险。

3)数量化的投资风险控制体系

公司针对投资过程中的事前风险、事中风险和事后风险建立了一整套的数量化风险控制体系,从而做到在每个环节有效控制风险点。

投资前的风险控制主要是通过严谨、细致的研究工作,定性与定量相结合的方法来实现。研究员通过实地调研对上市公司作出定性的判断,同时公司还通过量化的指标体系,如,风险指标体系(包括标准差、跟踪误差、下方风险、组合VaR等)、流动性指标体系等,挑选价值相对被低估的股票,运用数量化模型进行价值评估。

事中的风险控制通过两个手段来实现,一是在交易系统中设置风险控制条目,当基金经理下达与公司风险管理规定不符的指令时,指令将不能被执行,从技术上防止了不当投资行为的发生。第二是高频率的投资情况报告,可随时掌握投资过程中的股票仓位、集中度、流动性多方面的状况。

事后风险控制包括业绩评价和业绩归因,主要是把业绩逐层分解为资产策略配置效应、行业选择效应和个股选择效应,同时为优化投资策略提供参考。

3.内部控制制度

(1)内部控制的目标

为在守法经营、规范运作的基础上,实现持续、稳定、健康发展的经营目标,公司内部控制的总体目标为:

1)使公司诚实信用、勤勉尽责地为投资者服务,保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯;
2)保护公司资产的安全,实现公司经营方针和目标,维护股东权益;
3)树立良好的品牌形象,维护公司最重要的资本—声誉;
4)建立公司法人治理结构,建立符合现代管理要求的内部组织结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;

(下转D6版)

# 中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

## 基金管理人:诺安基金管理有限公司
## 基金托管人:交通银行股份有限公司

**重要提示**

1.中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会证监许可【2012】1065号文批准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断,推荐或保证。

2.本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3.本基金的管理人为诺安基金管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行"),注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金自2012年11月5日至2012年11月30日通过销售机构公开发售,投资者可选择网上现金认购、网下现金认购及网下股票认购等三种方式认购本基金,其中,网上现金认购的日期为2012年11月5日至2012年11月30日,网下现金认购的日期为2012年11月28日至2012年11月30日。如深圳证券交易所对网上现金认购时间做出调整,本公司将相应调整并及时公告。

5.本基金的网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理。

6.本公司可办理网下现金发售和网下股票发售。

7.本基金网下现金发售和网下股票发售的代理机构详见本公告第六部分。

8.本基金募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

9.本基金募集期内不设募集上限。

10.投资者认购本基金时需持有深圳证券交易所A股账户(以下简称"A股账户")或深圳证券交易所证券投资基金账户(以下简称"深圳证券交易所基金账户")。

(1)如投资者需新开立证券账户,则应注意:

①深圳证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回,则应开立A股账户。

②开户当日无法办理指定交易,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2)如投资者已开立证券账户,则应注意:

①如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购前至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

11.网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须在30万份以上(含30万份),超过部分须为1万份的整数倍。投资者通过发售代理机构进行网下股票认购的,单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分须为100股的整数倍;投资者通过基金管理人进行网下股票认购的,认购申报股数必须为100股的整数倍,单笔认购份额必须在50万份以上(含50万份)。上述认购方式投资者可以多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

12.投资者在认购本基金时,需按基金管理人、发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。认购委托一经确认,不得撤销。

13.基金发售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以基金合同生效后注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

14.本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在《证券时报》和本公司网站上的《中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在交通银行网站(www.bankcomm.com)和本公司网站(www.lionfund.com.cn)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务直销申请表格和了解基金募集相关事宜。

15.各发售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各发售机构咨询。

16.在募集期间,除本公告所列的发售机构外,本公司还可能增加新的发售机构,投资者可留意本公司公告信息或拨打本公司客户服务电话进行查询。

17.对未开设代销网点地区的投资者,请拨打本公司全国统一客户服务电话400-888-8998或直销中心咨询电话0755-83026620,垂询认购事宜。

18.本基金募集人可综合各种情况对募集安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

19.基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商(亦称"一级交易商")名单,报深圳证券交易所,经有关部门认可后,由深圳证券交易所公告。本基金上市后,指定交易未在一级交易商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖,如投资人需进行本基金的申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到本基金的一级交易商。

20.风险提示:投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。

本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。本基金以一元初始面值募集基金份额,在市场波动等因素的影响下,基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

一、本次募集基本情况

1.基金名称和代码

基金名称:中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金
场内简称:中小等权
场外简称:诺安中小板等权重ETF
基金代码:159921

2.基金类型

股票型基金

3.基金运作方式

交易型开放式

4.存续期限

不定期

5.基金份额初始发售面值

每份基金份额初始发售面值为1.00元人民币。

6.发售对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

7.募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

8.销售机构

(1)网下现金发售机构

本基金网下现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司。具体名单详见深圳证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

9.募集时间安排与基金合同生效

根据有关法律、法规的规定,本基金的募集期自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金募集期自2012年11月5日至2012年11月30日,期间面向投资者公开发售。基金管理人可以根据认购的情况提前终止或延迟发售时间,但最迟不得超过三个月的基金募集期。如遇突发事件,以上募集安排可以适当调整。

本基金自基金份额发售公告之日起三个月内,在基金募集份额不少于2亿份,募集金额不少于人民币2亿元,且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理人可以决定停止基金发售,并在聘请法定验资机构验资后向中国证监会办理基金备案手续。基金管理人在募集期内达到基金合同备案条件,办理完毕基金合同备案手续后,自中国证监会书面确认之日,基金合同生效,如果基金在规定时间内无法达到募集金额不少于2亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于200人的条件,则本基金合同不生效。

基金合同生效前,投资者的认购款项只能存入商业银行专门账户,任何人在基金募集期满前不得动用。基金合同生效时,认购款项在基金合同生效前产生的利息折算成基金份额归基金份额持有人所有,利息以注册登记人的记录为准。

基金管理人在募集期间未能达到基金合同的备案条件,基金合同不能生效,本基金管理人将承担因募集行为