

# 中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 更新招募说明书摘要 (2014 年第 1 号)

基金管理人：中邮创业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一四年七月

## 重要提示

本基金根据 2011 年 8 月 9 日中国证券监督管理委员会《关于核准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1261 号)的核准, 进行募集。

基金管理人保证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。

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, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。

投资有风险, 投资人投资于本基金前应认真阅读本招募说明书。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人基金投资要承担相应风险, 包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2014 年 5 月 22 日, 有关财务数据和净值表现数据截止日为 2014 年 3 月 31 日。本更新招募说明书已经基金托管人复核。

本更新招募说明书摘要摘自更新招募说明书正文, 投资者欲了解详细内容, 应阅读更新招募说明书正文。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人基本情况

名称：中邮创业基金管理有限公司

住所：北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层

办公地址：北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层

成立时间：2006 年 5 月 8 日

法定代表人：吴涛

注册资本：1 亿元人民币

股权结构：

股东名称 出资比例

首创证券有限责任公司 47%

中国邮政集团公司 29%

三井住友银行股份有限公司 24%

总 计 100%

公司客服电话：400-880-1618

公司联系电话：010-82295160

联系人：黄梦

## (二) 主要人员情况

### 1. 董事会成员

吴涛先生，公司董事长，大学本科，曾任国家外汇管理局储备司干部、中国新技术创业投资公司深圳证券营业部总经理、首创证券有限公司总经理，现任首创证券有限责任公司董事长。

俞昌建先生，董事，中共党员，高级会计师。曾任北京化工集团财务审计处副处长、北京航宇经济发展公司副总经理，北京首都创业集团财务部经理、财务总监，首创证券有限责任公司董事长，现任北京首创股份有限责任公司总经理。

章干泉先生，董事，中共党员，硕士学历，教授级高工。曾任长沙市邮电局分拣科、联合子弟学校、电信三分局员工、教员、长沙市电信局副局长、湖南省邮政局局长助理、副局长、局长及党组书记，现任北京市邮政公司总经理、党委副书记，现任北京市邮政速递物流有限公司董事长。

毕劲松先生，董事，硕士研究生。曾任中国人民银行金融管理司主任科员；国泰证券投资银行部副总经理；北京城市合作银行阜裕支行行长；国泰证券北京分公司总经理；国泰君安证券北京分公司总经理兼党委书记；中富证券有限责任公司筹备工作组长；中富证券有限责任公司董事长兼总裁；民生证券有限责任公司副总裁；首创证券有限责任公司副总经理；现任首创证券有限责任公司总经理，兼任京都期货有限公司董事长。

金昌雪先生，董事，大学本科。曾任职于北京煤炭管理干部学院（期间曾赴日本东丽大学任教、赴日本埼玉大学研究生院进修）；日本住友银行北京代表处职员、代表；日本三井住友银行北京代表处副代表兼北京分行筹备组副组长；2008年3月至今，任三井住友银行（中国）有限公司北京分行副行长、总行行长助理。

周克先生，董事，中共党员，硕士研究生。曾任中信实业银行北京分行制度科科长；中信实业银行总行开发部副总经理；中信实业银行总行阜成门支行行长；首创证券有限责任公司副总经理；现任中邮创业基金管理有限公司总经理。

王忠林先生，独立董事，曾在中国人民银行总行办公厅任职；在中国证券监督管理委员会任职，历任法律部稽查处负责人；稽查局信访处副处长、处长；办公厅信访办主任；2009年3月，自中国证监会退休。

刘桓先生，独立董事，大学本科。曾就职于北京市朝阳区服务公司；1978年至1982年，就读于中央财经金融学院；1982年7月至今，就职于中央财经大学，现任中央财经大学税务学院副院长。期间于2004年4月至2005年6月，在北京市地方税务局挂职锻炼，任职局长助理。

戴昌久先生，独立董事，法学硕士。曾在财政部条法司工作（1993年美国波士顿大学访问学者）；曾任职于中洲会计师事务所；1996年2月至今，任北京市昌久律师事务所（主任 / 支部书记）。期间任北京市律师协会五届、六届理事会理事；北京市律师协会预算委员会副主任、主任；北京市律师协会税务专业委员会副主任；全国律师协会财务委员会委员；曾任南方基金管理公司、(香港)裕田中国发展有限公司 独立董事；现任深圳天源迪科信息技术股份有限公司、信达金融租赁有限公司独立董事。

## 2. 监事会成员

张斌先生，监事长，中共党员，工商管理专业硕士学位，高级会计师。曾任北京东区邮电局安处邮电支局长；北京市邮政管理局经营财务处处长助理、副处长；国家邮政局计划财务部企业财务处副处长、处长；天津市邮政局副局长；国家邮政局计划财务部副主任；中国邮政集团公司财务部副总经理；现任中国邮政集团公司审计部副总经理(主持工作)、总经理。

周桂岩先生，监事，法学硕士。曾任中国信息信托投资公司证券部经理助理兼北京营业部总经理；北京凯源律师事务所律师；航空信托投资有限责任公司证券部总经理；首创证券有限责任公司资产管理总部总经理；现任首创证券有限责任公司合规总监兼合规部经理，京都期货有限公司监事；有二十多年证券从业经历。

石鲁先生，监事，大学本科。曾就职于北京云裳制衣有限公司财务部；中信银行北京分行营业部、阜成门支行会计部，任阜成门支行个人零售业务部主管；现任首誉资产管理有限公司副总经理。

张钧涛先生，监事，大学学历。曾任西南证券北京营业部客户经理；中国民族证券北京知春路营业部副总经理；中邮创业基金管理有限公司综合管理部副总经理、营销部副总经理、营销部总经理，现任中邮创业基金管理有限公司营销副总监。

刘桓先生，监事，大学学历。曾任真维斯国际香港有限公司北京分公司行政人事部主任；北京国声文化艺术有限公司副总经理；北京时代泛洋广告有限公司总经理；北京尚世先锋广告有限公司总经理；中邮创业基金管理有限公司客户服务部部门总经理助理，营销部副总经理，现任公司人力资源部总经理。

## 3. 公司高级管理人员

吴涛先生，公司董事长，大学本科，曾任国家外汇管理局储备司干部、中国新技术创业投资公司深圳证券营业部总经理、首创证券有限公司总经理，现任首创证券有限责任公司董事长。

周克先生，中共党员，硕士研究生。曾任中信实业银行总行开发部副总经理、首创证券有限公司副总经理，现任中邮创业基金管理有限公司总经理。

王金晖女士，工商管理硕士(MBA)。曾任国家体改委中华企业股份制咨询公司部门经理，南方证券公司投资银行部项目经理，河北证券有限责任公司研究发展部(筹)负责人、投资银行部总经理助理、北京营业部副总经理，融通基金管理有限公司总经理助理，现任中邮创业基金管理有限公司副总经理。

张静女士，金融学硕士，中共党员。曾任中国旅行社总社集团证券部、人力资源部职员；中国国际技术智力合作集团人力资源部副经理；中邮创业基金管理有限公司人力资源部总经理、公司人力资源总监、总经理助理、现任中邮创业基金管理有限公司副总经理。

李小丽女士，大学本科，中共党员，曾任邮电部邮政运输局财务处会计师；国家邮政局邮政储汇局（中国邮政储蓄银行前身）资金调度中心主任；中国邮政集团公司财务部资深经理，现任中邮创业基金管理有限公司副总经理。

郭建华先生，硕士研究生，曾任长城证券有限公司研发中心总经理助理、长城证券有限公司海口营业部总经理，现任中邮创业基金管理有限公司督察长。

## 4. 本基金基金经理

方向：男，理学硕士，2000年9月至2004年7月在安徽大学统计学专业学习；

2004年9月至2006年7月在中国人民大学概率论与数理统计专业学习并获得硕士学位；2006年4月至今任中邮创业基金管理有限公司研究员，负责金融工程研究。

#### 5、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：

委员会主席：

周克先生，见公司高级管理人员介绍。

委员：

邓立新先生：大学专科，曾任中国工商银行北京珠市口办事处交换员、中国工商银行北京信托投资公司白塔寺证券营业部副经理兼团支部书记、华夏证券有限公司北京三里河营业部交易部经理、首创证券有限责任公司投资部职员、中邮创业基金管理有限公司基金交易部总经理、投资研究部投资部负责人，现任投资副总监兼中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘涛先生：工商管理硕士，中共党员，曾任中国民族国际信托投资公司职员、安信证券股份有限公司研究员、中邮创业基金管理有限公司行业研究员、中邮核心主题股票型证券投资基金基金经理助理、研究部副总经理，现任中邮创业基金管理有限公司研究部总经理。

魏训平先生：金融学硕士，注册会计师，曾任天津开发区聚金投资咨询有限公司投资顾问、天津五洲联合会计师事务所审计师、中邮创业基金管理有限公司行业研究员，现任中邮创业基金管理有限公司研究部副总经理。

刘霄汉女士：经济学硕士，曾任中邮创业基金管理有限公司行业研究员，现任中邮核心主题股票型证券投资基金基金经理。

张萌女士：商学、经济学硕士，曾任中信银行总行营业部国际业务部主管、日本瑞穗银行悉尼分行资金部助理、澳大利亚康联首域全球资产管理公司全球固定收益与信用投资部基金交易经理、中邮创业基金管理有限公司固定收益部负责人，现任中邮创业基金管理有限公司固定收益部总经理兼中邮稳定收益债券型证券投资基金基金经理、中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理。

许进财先生：经济学硕士，曾任安信证券股份有限公司投资经理助理、中邮创业基金管理有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

方何先生：理学硕士，曾任中邮创业基金管理有限公司研究员，现任中邮上证380指数增强型证券投资基金基金经理兼中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

任泽松先生：理学硕士，曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理有限公司行业研究员、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理助理、中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金经理助理，现任投资部总经理助理兼中邮战略新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

陈钢先生：工商管理硕士，曾任汉唐证券研究部研究员、汇丰晋信基金管理有限公司研究部研究员、华夏基金管理有限公司金融工程部基金经理助理、新华资产管理有限公司研究发展部投资经理、华夏银行合资基金管理有限公司研究主管、中邮创业基金管理有限公司研究员、研究部行业和公司研究方面负责人、资产管理事业部

投资经理，现任投资部总经理助理兼中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理。  
刘格菘先生：经济学硕士，曾任广东发展银行大连分行国际部职员、中国人民银行营业管理部职员、中邮创业基金管理有限公司行业研究员、中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理助理，现任中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。  
陈梁先生：经济学硕士，曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员，现任中邮创业基金管理有限公司研究部副总经理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰伍拾伍万贰仟肆佰叁拾柒元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：(010) 66594942

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部成立于1998年，现有员工120余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

(1) 中邮创业基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层

联系人：隋奕

电话：010-82290840

传真：010-82294138

网址：[www.postfund.com.cn](http://www.postfund.com.cn)

#### 2. 代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号  
法定代表人：田国立  
客服电话：95566  
网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(2) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号  
办公地址：北京市西城区金融大街 3 号  
法定代表人：李国华  
联系人：陈春林  
客服电话：95580  
网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(3) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号  
办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号  
法定代表人：蒋超良  
联系人：刘一宁  
客户服务电话：95599  
网址：[www.95599.cn](http://www.95599.cn)

(4) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
法定代表人：姜建清  
客户服务电话：95588  
网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(5) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心  
法定代表人：王洪章  
客户服务电话：95533  
联系人：王琳  
网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  
法定代表人：傅育宁  
联系人：邓炯鹏  
客服电话：95555  
网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(7) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(8) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：丰靖

客服热线：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：谢小华

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(10) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

客服电话：021-962888

联系人：马云雁

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(11) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服热线：95511-3

网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(12) 首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人：吴涛

联系人：刘宇

客服电话：4006200620

网址：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：李洋，陈泉

联系电话：66568047

客服电话：4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(14) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

(15) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客服电话：4008-888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(16) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：汪建熙

联系人：李清怡

客服电话：021-962505

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

客服电话：4008-888-666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(18) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客服电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(19) 国信证券股份有限公司



注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人：何如

联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

客服电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(20) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

网站：<http://www.gf.com.cn>

(21) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(22) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(23) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008-888-111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(24) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国  
联系人：金芸、李笑鸣  
电话：021-23219000  
客户服务电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话  
网址：www.htsec.com

(25) 兴业证券股份有限公司  
注册地址：福建省福州市湖东路 268 号标力大厦  
法定代表人：兰荣  
联系人：夏中苏  
客户服务电话：95562  
网址：www.xyzq.com.cn

(26) 中信证券（浙江）有限责任公司  
注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层  
办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层  
法定代表人：沈强  
联系人：王霏霏  
客服电话：95548  
网址：www.bigsun.com.cn

(27) 齐鲁证券有限公司  
注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号  
法定代表人：李玮  
联系人：吴阳  
客服电话：95538  
网址：www.qlzq.com.cn

(28) 湘财证券有限责任公司  
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼  
法定代表人：林俊波  
联系人：钟康莺  
客服电话：400-888-1551  
网址：www.xcsc.com

(29) 长城证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层  
法定代表人：黄耀华  
联系人：匡婷  
电话：0755-83516289  
客服电话：0755-33680000 400-6666-888  
网址：www.cgws.com

(30) 光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
法定代表人：袁长清

联系人：刘晨

客服电话：4008888788

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（31）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

客服电话：95548

网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

（32）东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

联系人：张巧玲

联系电话：0769-22112062

客服电话：0769-961130

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

（33）新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

客服电话：400-698-9898

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

（34）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客服电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（35）浙商证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场

办公地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 6-7 层

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

联系电话：0571-87902080

客服电话：(0571) 967777

网址：[www.stocke.com](http://www.stocke.com)

(36) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法人代表：张华东

联系人：潘月

客服电话：4008-285-888

网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

(37) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：袁丽萍

客服电话：0510-82588168 400-888-5288

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(38) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-6768681

客服电话：400-8866-567

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(39) 日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：北京西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉、朱晓光

电话：010-88086830-730；010-88086830-737

客服电话：请拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

(40) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：010-66045608

客服电话：010-66045678

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(41) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406488

传真：029-87406387

联系人：冯萍

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

客户服务电话：029-95582

（42）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

全国免费业务咨询电话：4008816168

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国统一总机：4008866338

联系人：郑舒丽

网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

（43）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（44）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

联系人：赵明

客服电话：4006198888

公司网址：[www.msza.com](http://www.msza.com)

（45）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘一宏

电话：028-86690070

传真：028-86690126

客服电话：4006600109

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

（46）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张背北

电话：0451-85863696

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(47) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 04、18-21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

客服电话：95532、400 600 8008??

网址：www.china-invs.cn

(48) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

联系人：李二钢

电话：010--85188234

传真：010—62020088—8802

网址：www.myfund.com

(49) 方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：刘丹

客服电话：95571

网址：http://www.foundersc.com/

(50) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

客服电话：95503

网址：http://www.dfzq.com.cn/

(51) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(52) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

(53) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰????????????????

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn??、www.jjmmw.com

(54) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-58870011

传真：021-68596919

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(55) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

??办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

??法定代表人：凌顺平

??联系人：胡璇

??联系电话：0571-88911818-8653

??传真：0571-86800423

??客服电话：0571-88920897??????4008-773-772

??公司网站：??www.5ifund.com

(56) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

??办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

??联系人：潘世友

客服电话:400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(57) 万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人：李招弟

联系人：高晓芳

联系电话：010-59393923

传真：010-59393074

万银客服电话：400-808-0069

万银财富网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（58）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼

法定代表人：汪静波

联系人：魏可好

客服电话：400-821-5399

网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（59）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

（60）诚浩证券有限责任公司

注册地址：沈阳市沈河区热闹路49号

法定代表人：王晓

电话：024-22955419

网址：[www.chstock.com](http://www.chstock.com)

（61）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

法定代表人：马令海

联系人：邓洁

客服电话：4008507771

网址：<http://t.jrj.com>

（62）中期时代基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

客服电话：010-65807609

网址：[www.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com)

（63）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号



法定代表人：祝献忠  
联系人：黄恒  
客服电话：010-58568118  
网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

(64) 晋商银行股份有限公司  
注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦  
办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦  
法定代表人：上官永清  
客服电话：95105588  
网址：[www.jshbank.com](http://www.jshbank.com)

(69) 一路财富（北京）信息科技有限公司  
注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702  
办公地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702  
法定代表人：吴雪秀  
联系人：宋志强  
客户服务电话：400-001-1566  
网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(70) 北京钱景财富投资管理有限公司  
注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
法定代表人：赵荣春  
联系人：魏争  
客户服务电话：4006785095  
网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

(71) 开源证券有限责任公司  
注册地址：陕西省西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层  
办公地址：陕西省西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层  
法定代表人：李刚  
联系人：王姣  
客户服务电话：400-860-8866  
网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

(72) 华安证券股份有限公司  
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号  
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号  
法定代表人：李工  
联系人：甘霖  
客户服务电话：96518（安徽）、4008096518（全国）  
网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(73) 万联证券有限责任公司  
注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层  
办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

客服电话：4008888133

网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(74) 浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：毛真海

客户服务电话：95527

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.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本基金，并及时履行公告义务。

## (二) 基金注册登记机构

名称：中邮创业基金管理有限公司

住所：北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层

办公地址：北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层

法定代表人：吴涛

联系人：李焱

电话：010-82295160

传真：010-82292422

## (三) 律师事务所和经办律师

名称：北京市瑞天律师事务所

住所：北京市西城区莲花池东路甲 5 号院 1 号楼 18 层 1 单元 1805

负责人：姜森林

联系人：李飒

电话：010-63377073

传真：010-62116298

经办律师：李飒?? 刘敬华

## (四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：致同会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市建国门外大街 22 号赛特广场五层

法定代表人：徐华

联系人：卫俏嫔

联系电话：010-65264838

传真电话：010-65227521

经办注册会计师：王娟 卫俏嫔

## 四、基金的募集

本基金名称：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

## 五、基金类型

本基金类型：契约开放式、股票型

## 六、投资目标

本基金为股票指数增强型基金，以指数化分散投资为主，适度的增强型主动管理为辅，在严格控制跟踪偏离风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下，本基金力求控制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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## 七、投资范围

本基金资产投资于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(包括中小板和创业板，及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；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。

## 八、投资理念

本基金为股票指数增强型基金，以上证 380 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与数量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。

当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

## 九、投资策略

本基金为股票指数增强型基金，以上证 380 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与数量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。

当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金的投资策略包括以下几个层面：

### 1. 资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金，采用“被动投资为主，主动增强为辅”的投资策略。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，本基金投资

于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定)。

## 2. 股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股；主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究，优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选上证 380 指数成分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

本基金采用完全复制基准指数的方法，按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合，并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时，本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代；若成分股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

### (2) 构建增强型投资组合

本基金以指数化分散投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以适度的增强型主动管理；其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括：

#### 1) 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。

#### 2) 基本面优化

基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

?? 上市公司基本面较好(根据财务指标等判断)，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力。

?? 中长期估值水平明显高于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏低。

?? 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。

?? 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

?? 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑。

?? 中长期估值水平明显低于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏高。

?? 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调。

?? 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

#### 3) 个股优选

本基金将依托于本公司投研团队的研究成果，精选成分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。另外，本基金也可以适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）。

### 3. 债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期；通过对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略；通过对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略。

### 4. 股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分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、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### (1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的上证 380 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成分股调整生效前，分析并确定组合调整策略，并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### (2) 不定期调整

若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。

### 5. 跟踪误差控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

#### 十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点；指数样本每半年定期调整一次，实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间，若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数，该样本立

即被调出上证 380 指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时(如基金变更投资比例范围，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，或今后法律法规发生变化，又或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数等)，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，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

#### 十一、 风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

#### 十二、 投资决策依据

- (1) 国家有关法律法规和本基金基金合同的有关规定；
- (2) 标的指数编制、调整等相关规定，以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略；
- (3) 本基金对宏观经济走向、产业发展演变及上市公司基本面进行深入分析，对上市公司未来业绩进行预测，通过一定的价值评判标准对上市公司的投资价值进行分析，并在此基础上进行增强投资。

#### 十三、 投资决策流程

本基金的投资决策机制为，实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、行业研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

- (1) 策略研究员、行业研究员、债券研究员、金融工程研究员各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。
- (2) 金融工程小组利用量化模型进行指数化投资、投资组合优化和跟踪误差模拟测算，在此基础上进行投资论证，做出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置决策依据。
- (3) 基金经理根据金融工程小组提交的指数组合优化及风险测算的结果以及投资研究部提交的投资建议初步决定下一阶段的投资组合策略，形成资产配置提案报投资决策委员会。
- (4) 投资决策委员会每月召开投资策略会议，决定基金的大类资产配置比例和股票、债券的投资重点等。
- (5) 投资总监每周召集投资例会，根据投资决策委员会的决定，结合市场和公司基本面的变化，决定具体的投资策略。
- (6) 基金经理根据投资决策委员会的决策制定相应的指数化投资组合投资和优化方案，对超出基金经理权限的投资决策须报投资决策委员会审议核准。
- (7) 基金经理根据经投资决策委员会批准的基金投资组合方案，向交易部下达交易指令。
- (8) 交易部执行基金经理的交易指令，对交易情况及时反馈。
- (9) 风险控制部门负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估，定期提交组合

跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门及时进行投资组合的调整。

(10) 风险控制部门根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

#### 十四、 投资限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；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。

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限制。

(3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，本基金符合中国证监会有关要求的指数化投资部分不计入该限制。

(4) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。

(5) 本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基金资产净值的 10%；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%；本基金管理人管理的全部基金持有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) 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，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。

(7) 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%。

(8) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%。

(9) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

#### 十五、 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1. 承销证券；
2. 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，但是国务院另有规定的除外；
5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
  7. 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；
  8. 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。
- 若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### 十六、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金资产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 十七、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

#### 十八、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	27,503,309.97	91.37
	其中：股票	27,503,309.97	91.37
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,534,392.64	8.42
7	其他资产	63,951.62	0.21
	合计	30,101,654.23	100.00

##### 2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	215,100.00	0.74
B	采掘业	232,100.00	0.80
C	制造业	13,253,116.20	45.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,579,370.00	5.42
E	建筑业	607,860.00	2.09
F	批发和零售业	3,280,196.10	11.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,234,043.67	7.66
H	住宿和餐饮业	145,900.00	0.50



I	信息传输、软件和信息技术服务业	609,950.00	2.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	966,350.00	3.32
L	租赁和商务服务业	147,840.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	297,390.00	1.02
S	综合	394,980.00	1.36
	合计	23,964,195.97	82.22

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 3、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,093,690.00	7.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	215,100.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	228,750.00	0.78
J	金融业	250,400.00	0.86
K	房地产业	357,300.00	1.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	210,624.00	0.72
S	综合	183,250.00	0.63
	合计	3,539,114.00	12.14

### 4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600827	友谊股份	42,000	429,240.00	1.47
2	600422	昆明制药	15,000	358,650.00	1.23

3	601000	唐山港	70,000	338,800.00	1.16
4	600522	中天科技	28,250	328,265.00	1.13
5	600761	安徽合力	27,000	325,890.00	1.12
6	600697	欧亚集团	20,000	323,800.00	1.11
7	600594	益佰制药	7,781	318,631.95	1.09
8	600557	康缘药业	10,048	306,363.52	1.05
9	600387	海越股份	17,000	306,340.00	1.05
10	600511	国药股份	15,000	305,850.00	1.05

5、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔声学	16,000	409,600.00	1.41
2	000625	长安汽车	31,000	296,670.00	1.02
3	600366	宁波韵升	18,000	265,860.00	0.91
4	601992	金隅股份	40,000	258,800.00	0.89
5	601099	太平洋	40,000	250,400.00	0.86

6、报告期末按券种分类的债券投资组合：无

7、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：无

8、投资组合报告附注

（1）报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金的其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,831.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,280.00
4	应收利息	520.88
5	应收申购款	53,319.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,951.62

（4）报告期末无处于转股期的可转换债券。

（5）本报告期内未获得因股权分置改革被动持有的权证，无主动投资的权证。

（6）本报告期内权证持有情况：无。

（7）本报告期内及本报告期内没有持有资产支持证券。

（8）本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况：无

9、开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额 28,553,853.33

报告期期间基金总申购份额 6,112,042.82

报告期期间基金总赎回份额 5,858,801.12

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”列） -

报告期期末基金份额总额 28,807,095.03

## 10、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为 2011 年 11 月 22 日，基金合同生效以来的（截至 2014 年 3 月 31 日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011.11.22—2011.12.31	-0.40%	0.12%	-15.00%	1.45%	14.60%	-1.33%
2012.01.01—2012.12.31	-2.07%	1.24%	-0.95%	1.37%	-1.12%	-0.13%
2013.01.01—2013.12.31	13.23%	1.31%	13.25%	1.28%	-0.02%	0.03%
2014.01.01—2014.03.31	-3.07%	1.38%	-0.80%	1.28%	-2.27%	0.10%
2011.11.22—2014.03.31	7.06%	1.25%	-5.41%	1.33%	12.47%	-0.08%

## 十九、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
4. 基金合同生效以后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
7. 基金资产的资金汇划费用；
8. 基金的指数使用费；
9. 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金

托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2. 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 3. 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016 % (1.6 个基点) 的年费率计提，且收取下限为每季人民币伍 (5) 万元 (即不足 5 万元部分按照 5 万元收取)。计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% / \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### (四) 不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

### (五) 与基金销售有关的费用

1. 本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2. 本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高额不超过申购金额的 5%，具体如下：

申购金额 (元，含申购费) 申购费率

100 万元以下 1.20%

100 万元(含)至 200 万元以下 0.80%

200 万元(含)至 500 万元以下 0.30%

500 万元(含)以上 1000 元/笔

3. 本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费

率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：  
持有时间[1] 赎回费率

一年以下 0.5%

1 年(含 1 年)至 2 年 0.25%

2 年以上(含 2 年) 0%

注：[1] 就赎回费的计算而言，1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4. 本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25%的部分归入基金财产(具体比例见招募说明书)，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

5. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

#### (六) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### (七) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

#### 二十、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2014 年 1 月 3 日刊登的本基金招募说明书（《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“一、基金管理人”，对基金管理人情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”，对基金托管人情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”，对代销机构的内容均进行了更新；
- 4、在“九、基金的投资”，增加了基金的组合报告等内容；
- 5、在“二十二、其他应披露事项”，增加了本次更新内容期间的历次公告。

中邮创业基金管理有限公司

2014 年 07 月 03 日