

# 中邮创业基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开中邮上证

## 380 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性

### 公告

中邮创业基金管理股份有限公司于 2019 年 11 月 1 日发布了《中邮创业基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开中邮上证 380 指数增强型证券投资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二次提示性公告。

#### 一、召开会议基本情况

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中邮上证 380”）经中国证监会证监许可【2011】1261 号文核准募集。经中国证监会书面确认，《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2011 年 11 月 22 日生效。基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2019 年 11 月 11 日起至 2019 年 12 月 10 日 17:00 止（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）

3、会议计票日：2019 年 12 月 11 日

4、会议通讯表决票的寄达地点及联系方式如下：

公证机关：北京市方正公证处

联系地址：北京市西城区西环广场 T3 楼 12 层 1217 室

联系人：彭祎

联系电话：010-58073517

邮政编码：100044

请在信封背面注明：“中邮上证 380 基金份额持有人大会表决专用”

基金管理人客户服务统一咨询电话：400-880-1618

#### 二、会议审议事项

《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》（详见附件一）。

上述议案的内容说明请参见《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案的说明》（见附件二）。

#### 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2019 年 11 月 8 日，即该日交易结束后在本基金注册登记机构登记在册的中邮上证 380 全体基金份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

#### 四、投票方式

1、本次持有人大会的表决方式仅限于书面表决，表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录本基金管理人网站（<http://www.postfund.com.cn>）下载并打印等方式填制表决票。

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机构公章或经授权的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（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法人登记证书、有权部门的批文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身份证件正反面复印件、护照或其他身份证明文件的复印件，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，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(3) 基金份额持有人可根据本公告“五、授权”中规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人书面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权”中第（三）条授权方式中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件；

(4) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

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 2019 年 11 月 11 日起至 2019 年 12 月 10 日期间通过专人送交、快递或邮寄挂号信方式送达至以下地址：

公证机关：北京市方正公证处

联系地址：北京市西城区西环广场 T3 楼 12 层 1217 室

联系人：彭祎

联系电话：010-58073517

邮政编码：100044

请在信封背面注明：“中邮上证 380 基金份额持有人大会表决专用”

基金管理人客户服务统一咨询电话：400-880-1618

送达时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以公证机关签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

## 五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议，使基金份额持有人在本次会议上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。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基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

### （一）委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人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，一份基金份额享有一票表决权。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以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

### （三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过书面的授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本（见附件四）。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站

（<http://www.postfund.com.cn>）下载并打印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）个人投资者委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署授权委托书原件（见附件四），并提供基金份额持有人的个人身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；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法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；

（2）机构投资者委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（见附件四）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法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。如受托人为个人还需提供受托人的身份证件正反面复印件；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法人登记证书、有权部门的批文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，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（见附件四）并在授权委托书上加盖该机构公章（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身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，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，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，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；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法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

#### 2、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在多次以有效书面方式授权的，以时间在最后的一次书面授权为准。同时多次以有效书面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（2）如委托人未在授权委托书中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托书中表达多种表决意见的，视为无效授权；

（3）如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

### 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后第2个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### 2、表决票效力的认定如下：

（1）书面表决票通过专人送交、快递或邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准。2019年12月10日17:00以后送达公证机关的，为无效表决。

（2）书面表决票的效力认定：

1) 书面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公证机关的，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填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断, 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公证机关的, 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:

A. 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;

B. 送达时间为同一天的, 视为在同一表决票上做出了不同表决意见, 计入弃权表决票;

C. 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; 快递送达的, 以公证机关签收时间为准; 以邮寄挂号信方式送达的, 以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

#### 七、决议生效的条件

1、本基金份额持有人的每一份基金份额拥有同等的投票权。

2、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一), 则本次通讯会议有效召开; 在此基础上, 《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》须经参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效, 并自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告, 基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

#### 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《基金合同》的约定, 本次持有人大会需要参加大会的基金份额持有人或其代理人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一), 方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开, 根据《基金法》的规定, 基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就同一议案重新召集基金份额持有人大会, 但权益登记日仍为 2019 年 11 月 8 日。重新召集的基金份额持有人大会, 应当有代表本基金在权益登记日基金总份额三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见方可召开。

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作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作出授权, 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(如有)。

#### 九、本次持有人大会相关机构

1、召集人: 中邮创业基金管理股份有限公司

联系地址: 北京市东城区和平里中街乙 16 号

客户服务电话: 400-880-1618

网址: <http://www.postfund.com.cn>

2、基金托管人: 中国银行股份有限公司

3、公证机关: 北京市方正公证处

4、律师事务所：上海市海华永泰律师事务所

#### 十、重要提示

1、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。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站

(<http://www.postfund.com.cn>) 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 400-880-1618 咨询。

3、本公告的有关内容由中邮创业基金管理股份有限公司负责解释。

中邮创业基金管理股份有限公司

2019 年 11 月 1 日

附件一：《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案的说明》

附件三：《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》

附件一：

关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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》等法律法规的规定和《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本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，拟将“中邮上证 380 指数增强型证券投资基金”变更为“中邮中证 500 指数增强型证券投资基金”，并对《基金合同》中涉及基金名称、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金份额类别设置、申购费率、赎回费率、管理费率、销售服务费率等相关事项进行调整，并据此相应修改本基金的《托管协议》及《招募说明书》，更新后的《基金合同》《托管协议》以及《招募说明书》届时可详见基金管理人的官网。

为实施中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型事项，提议授权基金管理人办理本次基金变更的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，以及基金管理人在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据现时有效的法律法规对《基金合同》等法律文件进行其他必要的修订和补充。

本次转型的具体方案和程序可参见附件二《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案的说明》。

以上议案，请予审议。

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司 2019 年 11 月 1 日

附件二：

关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的说明

#### 一、重要提示

（一）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》（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》”）等法律法规规定和《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，本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，决定召开基金份额持有人大会，审议关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案。

（二）本次中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型事宜属对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。中国证监会对本次中邮上证 380 指数增强型证券投资基金的变更注册，不代表其对本次转型方案或本基金的价值或投资收益做出实质性判断或保证。

（三）本次基金转型方案需经参加本次持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 1/2 以上（含 1/2）通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

（四）基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并自通过之日起五日内报中国证监会备案。

## 二、基金转型方案要点

### （一）更名

基金名称由“中邮上证 380 指数增强型证券投资基金”变更为“中邮中证 500 指数增强型证券投资基金”。

### （二）基金的投资范围变化

投资范围中增加债券的具体内容，增加股指期货相关内容，删除权证相关内容，并增加本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务的安排。

变更后的投资范围：

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、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。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。

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非现金基金资产的比例不低于 80%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。

### （二）基金的资产配置策略、投资策略、投资组合比例限制变化

#### 1、资产配置策略变化

由采用“被动投资为主，主动增强为辅”的投资策略变更为国际通行的量化多因子选股模型进行投资。

变更后的资产配置策略：

本基金为股票指数增强型基金，采用国际通行的量化多因子选股模型进行投资。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非现金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、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、股票投资策略变化

由原来非量化的构建被动投资组合和构建增强投资组合，变化为“多因子模型”和“组合优化模型”、“风险模型”三部分构成的量化模型，使用估值类、盈利类、成长类因子等构建多因子模型，并基于交易成本、日跟踪偏离度等指标进行组合优化，最后基于行业、规模、波

动等指标进行风险估测构建风险模型。

#### 变更后股票投资策略

“本基金采用的量化模型主要分为‘多因子模型’和‘组合优化模型’、‘风险模型’三个部分：

##### ①多因子模型

首先，我们筛选出在 A 股具备长期超额收益的单因子构建因子池，单因子选择上，既要保证单因子超额收益的稳定性和统计学上的显著，也要保证因子具备一定的投资逻辑。单因子主要基于财务数据和量价数据构建，包括但不限于以下指标：

- i. 估值类因子：如市盈率、市净率、市销率等；
- ii. 盈利类因子：如总资产收益率、净资产收益率等；
- iii. 成长类因子：营业收入同比、净利润同比、经营现金流同比等；
- iv. 质量类因子：资产负债率、账面市值比等；
- v. 一致预期类因子：预期净利润、预期营业收入等；
- vi. 动量/反转类因子：20 日收益率、240 日收益率等；
- vii. 波动性因子：过去一个月日收益标准差、过去六个月日收益标准差等；
- viii. 流动性因子：过去一个月日均成交量、过去一个月日均换手率等；
- ix. 规模类因子：总市值、流动市值等；
- x. 其他：如分红类因子、其他技术类因子等；

之后，应用 ICIR、机器学习等方法对个股进行打分或收益率预测。

##### ②组合优化模型

我们将通过组合优化模型确定最终的投资组合，在模型构建时，包括但不限于以下限制条件：

- xi. 交易成本；
- xii. 组合相对基准指数的行业、市值偏离以及各类风险因子敞口（详见风险模型）；
- xiii. 投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例；
- xiv. 日均跟踪偏离度；

##### ③风险模型

通过构建风险模型控制投资组合在各类风险因子上的敞口，降低组合相对指数超额收益的波动，风险因子包括但不限于行业、规模、波动、成长等；”

#### 3、股票组合调整策略变化

在不定期调整中增加“此外，我们将根据组合效果、市场状况及交易成本等多个因素确定量化多因子选股模型的调仓频率。”内容。

#### 4、增加股指期货投资策略

“本基金在风险可控的前提下，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。选择流动性好且交易活跃的合约，根据对证券市场走势的判断，通过买入期货合约降低建仓期股票价格大幅上涨的风险，通过卖出期货合约对冲现货市场的下行风险。此外，通过股指期货的投资，还可以提升资金使用效率，降低仓位调整的交易成本以及跟踪误差。”

#### 5、增加资产支持证券投资策略

“本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。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。”

#### 6、增加融资及转融通证券出借业务投资策略

“本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参

与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。”

#### 7、投资组合比例限制的变化

根据投资范围变化增加了股指期货、融资及转融通相关投资限制，删除权证相关投资限制，其余根据证监会最近指引进行更新。

变更后投资组合比例限制

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非现金基金资产的比例不低于 80%。
- (2) 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、存出保证金和应收申购款等；
- (3) 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%；
- (4) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%；
- (7) 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；
- (8) 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；
- (9) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (11) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；
- (12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；
- (13) 本基金参与股指期货交易依据以下标准构建组合：
  - (13.1) 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%；
  - (13.2) 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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
  - (13.3) 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本基金持有的股票总市值的 20%；
  - (13.4) 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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的 90%-95%；



(13.5) 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%；

(14) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(15) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；出借期限在 10 个交易日以上的出借证券与其他流动性受限证券之和，不得超过基金资产净值的 15%；参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述（2）、（7）、（10）、（11）情形之外，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比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自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基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本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，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

（三）变更后的基金禁止行为变化

关于基金禁止行为中“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。”修改为“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者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，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，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，但法律法规另有规定的除外。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。”

（四）变更后的业绩比较基准变化

由于本基金变更跟踪指数，由上证 380 指数变更为中证 500，因此业绩比较基准由“上证 380 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”。

现业绩比较基准：“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”

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或市场推出代表性更强、投资人认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数时，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，并按照监管部门的要求履行适当程序，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介上刊登公告。”

（五）变更后的基金份额类别设置

本基金变更注册后由此前的单一份额类别设置变更为根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：

(1)在投资者认申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售

服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。

(2) 从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

基金变更注册实施后，原中邮上证 380 指数增强型证券投资基金份额将转型为中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式分别为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据基金运作情况，基金管理人可在不违反法律法规的规定和基金合同的约定以及对基金份额持有人无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商，在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平或收费方式、或者增加新的基金份额类别等，调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

(六) 变更后的基金的费用结构与费用水平

1. 变更后申购费、赎回费费率变化

1) 申购份额净值的计算方式由保留小数点后 3 位变为保留小数点后 4 位，并且本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

2) 收取申购费的 A 类份额的申购费率变化如下：

原申购费率：

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

现申购费率：

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。

投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额(M 元,前收费) 申购费率

$M < 100$  万元 1.5%

$100 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$  0.5%

$M \geq 500 \text{ 万元}$  1000 元/笔

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。

3) 赎回费率变化如下：

原赎回费率：

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。

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

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

0 天至 7 天 1.50%

7 天（含 7 天）至一年 0.50%

1 年(含 1 年)至 2 年 0.25%

2 年以上(含 2 年) 0.00%

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。

现赎回费率：

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。

本基金赎回费率随持有期限的增加而递减。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额采用相同的赎回费率结构，其赎回费率具体如下：

持有时间 赎回费率

$N < 7$  天 1.5%

$7 \leq N < 30$  天 0.1%

$N \geq 30$  天 0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。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。对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，赎回费全额计入基金财产。

## 2. 变更注册后管理费率、销售服务费变化

### （1）基金管理人的管理费变化

管理费率由原来的 1%，下降为 0.6%。

原管理费安排：

“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。”

现管理费安排：

“本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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）C 类份额的销售服务费

本基金增加 A、C 类份额划分，其中 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.3%的年费率计提，为新增费用安排。C 类份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类份额的销售服务费

E 为 C 类份额前一日基金资产净值

C 类份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 3. 变更后的基金指数使用费变化

基金的指数使用费费率无变化，但对支付方式进行了更详细的约定。

原文为：

“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。”

拟修改为：

“基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费率、具体计算方法及支付方式。”

### （七）变更后的基金的收益与分配

收益分配中删除如下四条收益分配原则：

(1) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配。

(2) 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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日。

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 50%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。

(4) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

(八) 变更注册后的基金的信息披露章节变化

根据 2019 年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同涉及信息披露相关内容，如增加基金产品资料概要相关要求、修改信息披露指定媒介相关内容等，并重点更新“第十七部分基金的信息披露”：

变更后基金合同基金的信息披露部分：

“1.本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

## 2.信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

3.本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1) 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2) 对证券投资业绩进行预测；
- 3) 违规承诺收益或者承担损失；
- 4) 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5) 登载任何自然人、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6) 中国证监会禁止的其他行为。

4.本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 5.公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

(1) 《基金合同》、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要

1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、

申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在3个工作日内更新招募说明书并登载在指定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书。

3) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在3个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

4) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

#### (2) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

#### (3) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### (4) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### (5) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (6) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载在指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所

所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （7）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2) 终止《基金合同》、基金清算；
- 3) 转换基金运作方式、基金合并；
- 4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- 9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13) 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者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 14) 基金收益分配事项；
- 15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17) 本基金开始办理申购、赎回；
- 18) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 19) 基金变更标的指数；
- 20) 基金推出新业务或服务；
- 21) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 22) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 23) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 24) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 25) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响

响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （9）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （9）清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （10）投资股指期货相关公告

本基金将在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （11）投资资产支持证券相关公告

基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

#### （12）参与融资和转融通证券出借交易的相关公告

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。

#### （13）中国证监会规定的其他信息。

### 6.信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法律法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。



## 7.信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。”

### （九）其他相关事项的修改

删除基金合同中关于权证、基金份额发售与基金备案的部分，并补充基金的历史沿革与存续等内容。

附件：中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基本情况

#### （一）产品概述

基金名称：中邮中证 500 指数增强型证券投资基金

基金的运作方式：契约型开放式

基金类别：股票型基金

基金存续期限：不定期

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。

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、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。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。

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非现金基金资产的比例不低于 80%；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%的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。。

业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征：

本基金是股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### （二）投资策略

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，采用国际通行的量化多因子选股模型进行投资。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非现金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、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

本基金采用的量化模型主要分为“多因子模型”和“组合优化模型”、“风险模型”三个部分：首先，我们筛选出在 A 股具备长期超额收益的单因子构建因子池，单因子选择上，既要保证单因子超额收益的稳定性和统计学上的显著，也要保证因子具备一定的投资逻辑，单因子主要基于财务数据和量价数据构建，包括但不限于估值类因子（如市盈率、市净率、市销率等）、盈利类因子（如总资产收益率、净资产收益率等）、成长类因子（营业收入同比、净利润同比、经营现金流同比等）等；然后，我们将通过交易成本、组合相对基准指数的行业、市值偏离以及各类风险因子敞口、投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例、日均跟踪偏离度几个限制条件构建组合优化模型，确定最终的投资组合；最后，通过构建风险模型控制投资组合在各类风险因子上的敞口，降低组合相对指数超额收益的波动，风险评测因子包括但不限于行业、规模、波动、成长等。

## 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。

## 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。

## 6、股指期货投资策略

本基金在风险可控的前提下，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。选择流动性好且交易活跃的合约，根据对证券市场走势的判断，通过买入期货合约降低建仓期股票价格大幅上涨的风险，通过卖出期货合约对冲现货市场的下行风险。

## 7、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。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。

## 8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

### （三）申购赎回方案

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购

开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

#### （四）基金注册登记的模式

本基金的登记业务由中邮创业基金管理股份有限公司办理。

#### （五）费率设计

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%的年费率计提。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。

3、本基金增加 A、C 类份额划分，其中 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.3%的年费率计提。

4、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。

投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额(M 元,前收费) 申购费率

M<100 万元 1.5%

100 万元≤M<500 万元 0.5%

M≥500 万元 1000 元/笔

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。

5、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 A 类基金份额和 C 类基金份额采用相同的赎回费率结构，其赎回费率具体如下：

持有时间 赎回费率

N<7 天 1.5%

7≤N<30 天 0.1%

N≥30 天 0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。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。对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，赎回费全额计入基金财产。

6、基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016%年费率计提。标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

本基金费率结构设计的出发点是更好服务于广大基金投资者的利益，总的设计原则是简单、透明、合理、有利于吸引投资者认购以及鼓励长期投资。

### 三、变更选择期的相关安排

本次基金份额持有人大会决议生效后，修改后的《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效前，本基金将安排选择期供基金份额持有人做出选择，具体安排以届时管理人公告为准。自选择期结束之日的次日起，中邮上证 380 指数增强型证券投资基金将正式转型为“中邮中证 500 指数增强型证券投资基金”。敬请投资者及时做出投资安排。在选择期间，本基金不开放申购业务，仅开放赎回业务。中邮上证 380 指数增强型证券投资

基金基金份额持有人可以将其持有的部分或全部基金份额赎回。在选择期内未申请赎回的中邮上证 380 指数增强型证券投资基金的基金份额将在《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效之日起自动变更为中邮中证 500 指数增强型证券投资基金的 A 类基金份额。

在选择期期间，为方便基金份额持有人赎回，基金份额持有人同意在选择期豁免《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》中关于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上述相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。

#### 四、基金转型的可行性

##### 1、法律层面

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十六条规定，“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过；……”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定，“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》中“九、基金份额持有人大会”项下约定“（二）有以下情形之一时，应当召开基金份额持有人大会：……6、变更基金投资目标、范围或策略；……9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项……”

因此，中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型事项不存在法律方面的障碍。

##### 2、基金转型不存在技术障碍

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金变更为中邮中证 500 指数增强型证券投资基金后，在技术系统运作上与基金管理人管理的其他同类基金并无明显差异，因而不存在技术操作上的障碍。

##### 3、准备工作有序进行

为了保障中邮上证 380 指数增强型证券投资基金份额持有人大会的顺利召开，本基金管理人成立了专门的工作小组，筹备持有人大会事宜，并与律师事务所、公证机构、机构投资者和部分个人客户进行了沟通，制定了客户通过通讯方式参与基金份额持有人大会的方式方法，从而保证基金份额持有人大会可以顺利进行。

#### 五、关于本基金实施转型的主要风险及预备措施

##### 1.基金转型方案被持有人大会否决的风险

为防范基金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，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以便为二次召集或推迟基金份额持有人大会的召开时间做充分准备。

如果议案未获得持有人大会的批准，基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交转型方案议案。

##### 2.基金转型方案通过后遭遇大规模赎回的风险

基金转型方案通过后，单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%时，为发生巨额赎回，基金管理人将根据基金合同关于巨额赎回的处理方式，合规地对大规模赎回申请进行全额赎回或者部分延期赎回，且为应对转型方案通过后遭遇大规模赎回，基金在转型期间将尽可能保证投资组合的流动性，应付

转型前后可能出现的较大规模赎回，降低净值波动率。

附件三：

中邮上证 380 指数增强型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：

证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）：

基金账户号：

审议事项 同意 反对 弃权

关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案

基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章

年月日

说明：请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选或字迹无法辨认、模糊不清或互相矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决结果均计为“弃权”，但计入有效表决票。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户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，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。表决票应附个人或机构有效身份证明文件复印件。

表决票效力认定的其他规则详见本次基金份额持有人大会公告。

附件四：

授权委托书

兹委托代表本人（或本机构）参加以通讯方式召开的中邮上证 380 指数增强型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。本授权不得转授权。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。若中邮上证 380 指数增强型证券投资基金在法定时间内重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）

委托人基金账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）：

委托日期：年月日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“基金账户号”，指基金份额持有人持有中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金份额的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金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，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的中邮上证 380 指数增强型证券投资基金所有份额。

2、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有中邮上证 380 指数增强型证券投资基金的基金份额，则其授权无效。

3、此授权委托书剪报、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。

中邮创业基金管理股份有限公司  
2019年11月5日