（上接B38版）

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2单元15层1507室
负责人：李飒
联系人：李飒
电话：010-62116298
传真：010-62216298
经办律师：刘敬华 李飒
(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
执行事务合伙人：徐华
联系人：卫俏嫔
联系电话：010-85665232
传真电话：010-85665320
经办注册会计师：卫俏嫔 李惠琦

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，除剔除上证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的决策依据。

(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，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。

(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2016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	117,579,749.43	91.14
	其中：股票	117,579,749.43	91.14
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	11,287,122.38	8.75
8	其他资产	140,077.98	0.11
9	合计	129,006,949.79	100.00

2、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	227,100.00	0.18
B	采矿业	3,846,026.00	3.00
C	制造业	62,708,710.67	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,361,409.50	4.95
E	建筑业	2,241,427.00	1.75
F	批发和零售业	9,155,718.00	7.13
G	交通运输、仓储和邮政业	9,782,400.72	7.62
H	住宿和餐饮业	850,378.54	0.66
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,816,929.00	3.75
J	金融业	–	–
K	房地产业	4,665,289.00	3.63
L	租赁和商务服务业	2,905,012.00	2.26
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	2,058,967.00	1.60
S	综合	2,390,018.00	1.86
	合计	112,009,385.43	87.24

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	580,548.00	0.45
C	制造业	3,262,365.00	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,160.00	0.17
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	519,300.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	633,600.00	0.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	358,391.00	0.28
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	5,570,364.00	4.34

4、报告期末指数投资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	600009	上海机场	85,500	2,572,695.00	2.00
2	600398	海澜之家	174,500	2,008,495.00	1.56
3	600498	烽火通信	72,700	1,829,132.00	1.42
4	601021	春秋航空	36,866	1,711,319.72	1.33
5	600522	中天科技	90,577	1,683,826.43	1.31
6	601888	中国国旅	32,400	1,479,060.00	1.15
7	600079	人福医药	79,100	1,471,260.00	1.15
8	600673	东阳光科	169,000	1,446,640.00	1.13
9	600655	豫园商城	103,700	1,332,545.00	1.04
10	600694	大商股份	31,400	1,236,532.00	0.96

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	600688	上海石化	101,300	690,866.00	0.54
2	601179	中国西电	115,800	650,796.00	0.51
3	601333	广深铁路	158,400	633,600.00	0.49
4	600153	建发股份	30,000	519,300.00	0.40
5	601608	中信重工	77,800	424,788.00	0.33

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	72,591.43
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,201.23
5	应收申购款	65,285.32
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	140,077.98

（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）本报告期末权证持有情况：无。

（7）本报告期内及本报告期末没有持有资产支持证券。

（8）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明：

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	519,300.00	0.40	重大事项

9、开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	40,277,128.52
报告期期间基金总申购份额	40,824,964.39
减：报告期期间基金总赎回份额	5,175,441.15
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
报告期期末基金份额总额	75,926,651.76

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，也不保证投资者最低收益。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2016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—2016.3.31	78.88%	1.82%	51.78%	1.88%	27.1%	-0.06%

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×1.0%÷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×0.2%÷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×0.016 %/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。

中邮创业基金管理股份有限公司
2016年7月5日

证券代码：002377 证券简称：国创高新 编号：2016-35号
债券代码：112096 债券简称：12国创债

湖北国创高新材料股份有限公司 “12国创债”2016年付息公告

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确和完整，对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

特别提示：

湖北国创高新材料股份有限公司2012年公司债券（以下简称"本期债券"）本次付息的债权登记日为2016年7月8日，凡在2016年7月8日（含）前买入并持有本期债券的投资者享有本次派发的利息；2016年7月8日卖出本期债券的投资者不享有本次派发的利息。

湖北国创高新材料股份有限公司（简称"本公司"）于2012年7月10日发行的湖北国创高新材料股份有限公司2012年公司债券（简称"12国创债"、"本期债券"、债券代码112096）至2016年7月9日将期满4年。根据本公司"12国创债"《公开发行公司债券募集说明书》和《公司债券上市公告书》有关条款的规定，在本期债券的计息期限内，每年付息一次，现将有关事项公告如下：

一、本期债券的基本情况

1、债券名称：湖北国创高新材料股份有限公司2012年公司债券。

2、债券简称及代码：12国创债（112096）。

3、发行规模：人民币2.7亿元。

4、债券期限：本期债券期限为5年。

5、债券利率：票面利率6.20%（固定利率）。

6、债券发行价格：每张人民币100元。

7、债券形式：实名制记账式公司债券。

8、还本付息方式：采用单利按年计息，不计复利。按年付息、到期一次还本，最后一期利息随本金一起支付。

9、起息日：2012年7月10日。

10、付息日：2013至2017年每年的7月10日为上一个计息年度的付息日（如遇法定及政府指定节假日或休息日，则顺延至其后的第1个工作日；顺延期间付息款项不另计利息）。

11、担保情况：国创高科实业集团有限公司为本次公司债券提供全额无条件的不可撤销的连带责任保证担保；湖北武麻高速公路有限公司以其合法拥有的武汉至麻城高速公路武汉段项目公路收费权为本次债券的还本付息提供质押担保。担保人保证的范围包括本期债券的全部本金及利息、违约金、损害赔偿金、实现债权的全部费用和其他应支付的费用。

12、信用级别：经鹏元资信评估有限公司（以下简称"鹏元资信"）综合评定，发行人的主体评级为AA，本期债券的信用评级为AA+。

13、上市时间和地点：本期债券于2012年8月2日在深圳证券交易所上市交易。

14、登记、托管、委托债券付息、兑付机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称"中国结算深圳分公司"）。

15、本期债券下一付息期票面利率：6.2%。

16、本期债券下一付息期起息日：2016年7月10日。

二、本次付息方案

按照《湖北国创高新材料股份有限公司公司2012年公司债券票面利率公告》，"12国创债"的票面利率为6.20%，每手"12国创债"（面值1,000元）派发利息为人民币：62.000000元（含税。扣税后个人、证券投资基金债券持有人实际每手派发利息为：49.600000元；扣税后非居民企业（包含QFII、RQFII）取得的实际每手派发利息为：55.800000元）。

三、付息债权登记日、除息日及付息日

1、付息债权登记日：2016年7月8日

2、除息日：2016年7月11日

3、付息日：2016年7月11日

四、付息对象

本次付息对象为：截止2016年7月8日（该日期为债权登记日）下午深圳证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称：中国结算深圳分公司）登记在册的全体"12国创债"持有人（界定标准请参见本公告的"特别提示"）。

五、付息办法

公司将委托中国结算深圳分公司进行本次付息。

在本次付息日2个交易日前，公司会将本期债券本次利息足额划付至中国结算深圳分公司指定的银行账户。中国结算深圳分公司收到款项后，通过资金结算系统将本期债券本次利息划付给相应的付息网点（由债券持有人指定的证券公司营业部或中国结算深圳分公司认可的其他机构）。

本公司与中国结算深圳分公司的相关协议规定，本公司未按时足额将债券付息资金划入中国结算深圳分公司指定的银行账户，则后续付息工作由本公司自行负责处理，相关实施事宜以本公司的相关公告为准。

六、关于本次付息对象缴纳公司债券利息所得税的说明

1、个人缴纳公司债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国个人所得税法》以及其他相关税收法规和文件的规定，本期债券个人（包括证券投资基金）债券持有者应缴纳企业债券利息个人所得税，征税税率为利息额的20%。根据《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》（国税函[2003]612号）规定，本期债券利息个人所得税统一由各付息网点在向债券持有人支付利息时负责代扣代缴，就地入库。

2、非居民企业缴纳公司债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国个人所得税法》及其实施条例、《非居民企业所得税源泉扣缴管理暂行办法》（国税发[2009]3号）等规定，本期债券非居民企业（包括QFII、RQFII）债券持有者取得的本期债券利息应缴纳10%企业所得税，由本公司负责代扣代缴。

3、其他债券持有者缴纳公司债券利息所得税的说明

其他债券持有者的债券利息所得税需自行缴纳。

七、咨询联系方式

1、发行人：湖北国创高新材料股份有限公司
法定代表人：高庆寿
地址：武汉市东湖新技术开发区武大园三路8号
邮编：430223
联系人：彭雅超
咨询电话：027-87617347-6600
传真：027-87617400

2、保荐人、债券受托管理人、主承销商：新时代证券有限责任公司
法定代表人：刘汝军
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
联系人：谭斯哲
联系电话：010-83561000
传真：010-83561001

3、托管机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
地址：广东省深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场22-28楼
联系人：韦爱静
联系电话：0755-21899305
邮政编码：518038

特此公告。

湖北国创高新材料股份有限公司董事会
二〇一六年七月一日

证券代码 ：000593 证券简称：大通燃气 公告编号：2016-043

四川大通燃气开发股份有限公司 关于公司第一大股东部分股权解除质押和质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司近日接到第一大股东天津大通投资集团有限公司（以下简称“大通集团”）的函告，获悉大通集团所持有本公司的部分股份被解除质押和质押，具体情况如下：

一、本次股东股份被解除质押和质押的基本情况

1、本次股东股份被解除质押基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	解除质押股数	质押开始日期	质押到期日	质权人	本次解除质押占其所持股份比例	用途
大通集团	是	190万股	2016年2月26日	双方申请解冻为止	天津信托有限责任公司	1.28%	资金调度需要
合计		190万股				1.28%	

2、本次股东股份被质押基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数	质押开始日期	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
大通集团	是	190万股	2016年7月1日	双方申请解冻为止	天津信托有限责任公司	1.28%	为融资提供担保
合计		190万股				1.28%	

二、股东股份累计被质押的情况

截至本公告日，大通集团直接以及通过中信证券收益互换方式合计持有公司股份147,939,528股，占公司总股本的41.25%，其中：大通集团直接持有公司股份146,825,228股，占公司总股本的40.94%，大通集团通过股票收益互换方式持有公司股份1,114,300股，占公司总股本的0.31%。截至本公告日，大通集团持有公司股份累计被质押的数量为146,814,569股，占公司总股本的40.94%。

三、备查文件

1、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结数据明细；

2、中国证券登记结算有限责任公司解除证券质押登记通知；

3、中国证券登记结算有限责任公司证券质押登记证明。

特此公告。

四川大通燃气开发股份有限公司
董事会
二〇一六年七月四日

证券代码：002283 股票简称：天润曲轴 编号：2016-034

天润曲轴股份有限公司 关于重大资产重组停牌的进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

天润曲轴股份有限公司（以下简称"公司"）因拟与轻量化结构件生产企业洽谈合作事项，该事项可能涉及重大资产重组，经向深圳证券交易所申请，公司股票（证券简称：天润曲轴，证券代码：002283）自2016年3月23日开市起停牌。公司于2016年3月23日披露了《关于筹划重大事项停牌公告》（公告编号：2016-004），于2016年3月30日、2016年4月7日、2016年4月14日分别披露了《重大事项停牌进展公告》（公告编号：2016-005、2016-014、2016-016）。

后经确认，公司筹划的重大事项构成重大资产重组，经向深圳证券交易所申请，公司股票自2016年4月21日起继续停牌。公司于2016年4月21日披露了《关于重大资产重组停牌的公告》（公告编号：2016-017），于2016年4月28日、2016年5月6日、2016年5月13日、2016年5月20日、2016年5月27日、2016年6月3日、2016年6月14日、2016年6月21日分别披露了《关于重大资产重组停牌的进展公告》（公告编号：2016-019、2016-020、2016-021、2016-022、2016-023、2016-027、2016-029、2016-030）。

2016年6月21日，公司召开2015年度股东大会审议通过了《关于继续停牌筹划重大资产重组事项的议案》，后经公司向深圳证券交易所申请，公司股票自2016年6月23日起继续停牌三个月。公司于2016年6月22日披露了《关于筹划重大资产重组继续停牌的公告》（公告编号：2016-032）。2016年6月28日公司披露了《关于重大资产重组停牌的进展公告》（公告编号：2016-033）。

截至本公告披露日，本次重大资产重组事项仍在推进过程中，公司及独立财务顾问、审计、律师、评估等中介机构继续对标的公司进行尽职调查。鉴于该事项尚存在不确定性，为保证公平信息披露，维护广大投资者利益，避免公司股价异常波动，公司股票继续停牌。停牌期间，公司将充分关注本次重大资产重组事项的进展情况并积极履行信息披露义务，至少每五个交易日发布一次重大资产重组事项的进展公告。

公司发布的信息以在指定信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）刊登的公告为准。本次重大资产重组事项尚存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

天润曲轴股份有限公司
董 事 会
2016年7月5日

证券代码：002297 证券简称：博云新材 编号：2016-031

湖南博云新材料股份有限公司 关于产业并购基金合伙人变更的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

湖南博云新材料股份有限公司（以下简称“公司”）于2015年11月12日召开的第四届董事会第四十五次会议审议通过了《关于控股子公司投资设立产业并购基金的议案》，同意控股子公司湖南博云东方粉末冶金有限公司（以下简称“博云东方”）以自有资金人民币3,000万元参与投资上海秋石投控资产管理有限公司（以下简称“上海秋石”）发起设立的产业并购基金——上海湘秋投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“上海湘秋”），详见公司2015年11月13日披露于指定媒体和巨潮资讯网上的《关于控股子公司投资设立产业并购基金的公告》（公告编号2015-051）。

2016年7月1日，公司收到控股子公司博云东方出具的“关于参与投资的并购基金合伙人变更的情况说明”，博云东方于2016年7月1日收到“上海湘秋关于合伙人变更事项告知函”，函件称：上海湘秋于2016年6月20日向上海浦东新区市场监督管理局申请合伙人变更，将上海湘秋原普通合伙人上海秋石变更为启迪海中信金控资本管理（北京）有限公司（以下简称“启海资本”），原有限合伙人厦门秋石二号投资管理合伙企业（有限合伙）变更为海中信实业投资有限公司(以下简称“海中信”)，基金整体规模不变，并已于2016年6月27日收到上海浦东新区市场监督管理局颁发的变更后营业执照。具体情况如下：

一、上海湘秋合伙人变更情况

上海湘秋的普通合伙人上海秋石变更为启海资本，有限合伙人厦门秋石二号投资管理合伙企业（有限合伙）变更为海中信，启海资本与海中信所持上海湘秋投资份额与原上海秋石与厦门秋石所持投资份额相同，未发生变化。上海湘秋的合伙人结构变更如下：

变更前：

合伙人名称	认缴出资额（万元）
普通合伙人（并任执行事务合伙人）	
上海秋石投控资产管理有限公司	100
有限合伙人	
湖南博云东方粉末冶金有限公司	3,000
周旭东	1,500
林燕雯	3,700
陈炼	800
厦门秋石二号投资管理合伙企业（有限合伙）	23,900
合计	33,000

变更后：

合伙人名称	认缴出资额（万元）
普通合伙人（并任执行事务合伙人）	
启迪海中信金控资本管理（北京）有限公司	100
有限合伙人	
湖南博云东方粉末冶金有限公司	3,000
周旭东	1,500
林燕雯	3,700
陈炼	800
海中信实业投资有限公司	23,900
合计	33,000

二、启海资本的控股股东、实际控制人和主要投资领域。

1、启海资本的股权结构如下图所示：

2、海中信持有启海资本 40%股权，为启海资本的主要股东之一。

海中信持有北京市工商管理局核发的统一社会信用代码为：91110108556876171M，注册资本金12000万元人民币，注册地址为北京市海淀区西直门外大街168号腾达大厦17层1709B室，经营范围为“项目投资；投资管理；资产管理；技术推广；销售建筑材料、日用品、机械电器设备、电子产品、纺织品、工艺品、家具；图文设计制作；企业策划；经济贸易咨询。（1、不得以公开方式募集资金；2、不得公开交易证券类产品和金融衍生品；3、不得发放贷款；4、不得向所投资企业以外的其他企业提供担保；5、不得向所投资者承诺投资本金不受损失或者承诺最低收益；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）”，其股权结构如下：

序号	股东名称	出资额（万元）	股权比例（%）
1	郭祥恩	6600	55
2	李永泉	3400	28.33
3	佟学民	1000	8.33
4	许克强	1000	8.33
	合计	12000	100

3、自然人股东王力光先生持有启海资本40%股权，为启海资本的主要股东之一。

王力光先生，1971年出生。清华大学本科、硕士研究生毕业，清华-MIT 联合授予IMBA学位。现任启海资本法定代表人、董事长。

4、启迪（北京）科技城投资发展有限公司（“启迪科技城”）持有启海资本20%股权，为启海资本的主要股东之一。

启迪科技城持有北京市工商管理局核发的注册号为110108019032568号的《企业法人营业执照》，注册资本为人民币20000万元人民币，注册地址为北京市海淀区中关村东路1号院1号楼A座14层1419，经营范围为“物业管理；投资管理；项目开发；投资咨询；企业管理咨询；出租办公用房；企业策划；经济贸易咨询；技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务、技术推广。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）”，其股权结构如下：

序号	股东名称	出资额（万元）	股权比例（%）
1	启迪控股股份有限公司	20000	100

5、启海资本股权结构上无单一最大持股股东，因此无实际控制人。由现有股东根据公司法及公司章程要求共同决策。

6、启海资本成立于2015年10月，住所为北京市石景山区实兴大街30号院3号楼2层D-0717房间，上海湘秋是启海资本设立以来的首个投资管理项目。启海资本的主营业务为资产管理、项目投资，目前未限定于特定的投资领域。

三、启海资本是否与公司控股股东、实际控制人、持股5%以上的股东、董事、监事、高级管理人员存在关联关系或利益安排、是否与其他参与设立投资基金的投资人存在一致行动关系。

1、启海资本与公司控股股东、实际控制人、持股5%以上的股东、董事、监事、高级管理人员不存在关联关系或利益安排。

2、启海资本与除海中信之外的其他参与设立投资基金的投资人不存在一致行动关系。

海中信是启海资本股东之一，海中信与启海资本存在一致行动关系。

除海中信外，博云东方与启海资本不存在一致行动关系。

周旭东、林燕雯、陈炼是财务投资人，其中周旭东及陈炼在刀具及其相关行业具有一定经验及背景，他们作为投资人参与了设立投资基金，与启海资本不存在一致行动关系。

四、合伙人变更对基金运作的影响

经了解，启海资本的管理团队产业背景强，知识结构合理，管理理念先进，认可产业基金的投资方向。海中信是由一批在实业、金融等领域具有丰富经验的投资者组建的实业投资公司，有较多成功投资经验。因此，变更后的合伙人有助于实现并购产业基金设立的目的。

特此公告。

湖南博云新材料股份有限公司
董事会
2016年7月4日