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纯债聚利债券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 12 月 31 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纯债聚利债券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

中邮纯债聚利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中邮纯债聚利”）经中国证监会证监许可【2015】2847 号文注册募集。经中国证监会书面确认，《中邮纯债聚利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2016 年 2 月 3 日生效。基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。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《关于中邮纯债聚利债券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 2020 年 1 月 7 日起至 2020 年 2 月 6 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：2020 年 2 月 7 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：“中邮纯债聚利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

《关于中邮纯债聚利债券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《关于中邮纯债聚利债券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 2020 年 1 月 6 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纯债聚利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，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本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 2020 年 1 月 7 日起至 2020 年 2 月 6 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：“中邮纯债聚利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在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（中国农业银行股份有限公司）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。2020 年 2 月 6 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，《关于中邮纯债聚利债券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 2020 年 1 月 6 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：中国农业银行股份有限公司

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 12 月 31 日

附件一：《关于中邮纯债聚利债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《关于中邮纯债聚利债券型证券投资基金转型有关事项的议案的说明》

附件三：《中邮纯债聚利债券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：

关于中邮纯债聚利债券型证券投资基金转型有关事项的议案

中邮纯债聚利债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为提高基金资产的运作效率，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《中邮纯债聚利债券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农业银行股份有限公司协商一致，拟修改《基金合同》的投资范围，并对本次修改所涉及的投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值对象、估值原则、估值方法、信息披露等内容进行相应调整及更新，同时调整本基金赎回费率；并将对相关法律文件所涉及的内容进行相应更新，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。

为实施中邮纯债聚利债券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《关于中邮纯债聚利债券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 12 月 31 日

附件二：

关于中邮纯债聚利债券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《中邮纯债聚利债券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农业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，审议关于中邮纯债聚利债券型证券投资基金转型有关事项的议案。

（二）本次中邮纯债聚利债券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纯债聚利债券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

本次变更注册涉及基金合同的修改，具体修改内容如下：

（一）基金的投资范围变化

“第十二部分 基金的投资”章节，“二、投资范围”部分，原表述：

本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，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、可转换债券（含可分离交易可转债）、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、中小企业私募债券等固定收益金融工具，债券回购、银行存款、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类金融工具，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债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；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

变更后：

本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、政策性金融债、央行票据）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不参与股票等权益类资产的投资，不参与国债期货投资，同时本基金不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金每个交易日日终应当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、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（二）基金的投资策略变化

“第十二部分 基金的投资”章节，“三、投资策略”部分，原表述：

本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。

主动管理：我国债券市场运作时间短，市场规模较小，参与主体少，债券市场还处于不断完善和发展的过程中。由于我国债券市场的不完全有效性为基金管理人通过积极的投资策略，实现基金资产的长期稳定增值提供了可能性。本基金管理人将通过增强对宏观、市场利率和债券市场发展的认识和预测，运用市场时机选择、期限选择和类别选择等方式，在控制投资风险的前提下力争获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。

数量投资：通过数量化分析债券久期、凸性、利率、流动性和信用风险等因素，寻找被市场错误定价或严重低估的偏离价值区域的券种。通过科学的计算方法，严格测算和比较该项投资的风险与预期投资收益水平，研究分析所选定的品种是否符合投资目标，是否具有投资价值，并选择有利时机进行投资决策。

组合投资：债券收益率曲线的变动并不是整体平行移动，而具有不平衡性，往往收益率曲线的某几个期限段的变动较为突出，收益率曲线变动的不平衡性为基金管理人集中投资于某几个期限段的债券提供了条件。基金管理人可根据不同债种的风险收益特征，在不同市场环境下进行不同比例的组合投资，采用哑铃型、子弹型、阶梯型等方式进行债券组合。

（一）资产配置策略

本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济形势发展和变动趋势，基于对财政政策、货币政策和债券市场的综合研判，在遵守有关投资限制规定的前提下，灵活运用投资策略，配置基金资产，力争在保障基金资产流动性和本金安全的前提下实现投资组合收益的最大化。

本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益资产（国债、央行票据等）和现金之间的配置：①基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；②对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场的影响；③套利性投资机会的投资期间及预期收益率。

（二）平均久期配置策略

本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、通胀率、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）等进行定性和定量分析，预测未来的利率变化趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并据此积极调整债券组合的平均久期，有效控制基金资产风险，提高债券组合的总投资收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。

（三）期限结构配置策略

结合对宏观经济形势和政策的判断，本基金对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，选择合适的期限结构配置策略，配置各期限固定收益品种的比例，以达到预期投资收益最大化的目的。

（四）类属配置策略

研究同期限的国债、金融债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。

（五）非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）的选择

本基金对国债、央行票据等非信用类固定收益品种的投资，主要根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种。

（三）基金投资限制变化

“第十二部分 基金的投资”章节，“四、投资限制”，“1、组合限制”部分，原表述：

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除国债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，其中现金类资产不包括结 算备付金、存出保证金及应收申购款等；

（3）本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类金融工具，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出；

（4）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（6）本基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的全部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的 20%；

（7）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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前款所规定的流动性受限资产比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（8）本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（9）本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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%；法律法规或中国证监会另有规定，遵从其规定；

（10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（11）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；

（12）本基金管理人管理的全部证券投资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%；

（13）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

（14）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；

（15）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

（16）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

（17）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

（18）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券资产投资比例的有关约定；

（19）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（20）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基金合同约定的投资范围保持一致；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（7）、（14）、（20）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。

变更后：

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终应当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、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5）本基金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；

（6）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、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；

（7）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；

（8）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（6）、（7）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。法律法规另有规定的，从其规定。

（四）基金业绩比较基准变化

“第十二部分 基金的投资”章节，“五、业绩比较基准”部分，原表述：

本基金业绩比较基准：中国债券综合财富指数

中国债券综合财富指数是全市场债券指数，由中央国债登记结算有限责任公司编制，以 2002 年 1 月 4 日为基期，基点为 100 点，并于 2007 年 11 月 26 日正式发布。中国债券综合财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素；其样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场、柜台交易市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威、应用最广的指数之一。中国债券综合财富指数能够客观地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金的业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

变更后：

本基金业绩比较基准：中债总全价（总值）指数收益率

中债总全价（总值）指数是中央国债登记结算公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖国债、央行票据和政策性金融债，是一个反映境内利率类债券整体价格走势情况的分类指数，也是中债指数应用最广泛指数之一。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中债总全价（总值）指数作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

（五）基金估值对象变化

“第十四部分 基金资产估值”章节，“二、估值对象”部分，原表述：

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、国债期货、其它投资等资产及负债。

变更后：

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（六）根据证券投资基金基金合同填报指引补充估值原则

七、“第十四部分 基金资产估值”章节，新增“三、估值原则”部分，新增：

三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（七）基金估值方法变化

“第十四部分 基金资产估值”章节，原“三、估值方法”部分调整为“四、估值方法”，并对估值方法具体内容进行了修改，原表述：

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。持续评估上述做法的适当性，并可在情况发生改变时做出适当调整。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值进行估值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定其公允价值进行估值。

3、对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、国债期货合约估值方法

本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（八）基金信息披露相关内容变化

“第十八部分 基金的信息披露”章节，“五、公开披露的基金信息”、“（十）投资中小企业私募债信息披露”至“（十二）投资国债期货的信息披露”部分，原表述：

（十）投资中小企业私募债信息披露

1、基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

2、基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

（十一）投资资产支持证券信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报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。

基金管理人应在基金季度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末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十二）投资国债期货的信息披露

基金在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书更新等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债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。

变更后：

删除“（十）投资中小企业私募债信息披露”、“（十一）投资资产支持证券信息披露”、“（十二）投资国债期货的信息披露”相关内容。

（九）删除“基金份额的发售”，变更为“基金的历史沿革”

删除基金合同中原“第四部分 基金份额的发售”章节，变更为“第四部分 基金的历史沿革”章节，变更后的内容为：

中邮纯债聚利债券型证券投资基金经中国证监会 2015 年 12 月 8 日《关于准予中邮纯债聚利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2847 号）的核准，进行募集，基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

中邮纯债聚利债券型证券投资基金自 2016 年 1 月 22 日至 2016 年 1 月 29 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认（机构部函 [2016]