

中邮新锐量化选股混合型发起式证券投资基金份额发售公告

重要提示

1. 中邮新锐量化选股混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的发售已获中国证券监督管理委员会2025年8月22日证监许可[2025]1833号文批准。

2. 本基金是混合型证券投资基金。

3. 基金的运作方式:契约型开放式。

4. 本基金的管理人和注册登记机构均为中邮创业基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”),托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。

5. 本基金自2025年10月13日至2025年10月31日,通过本公司指定的销售机构(包括直销机构和其他销售机构)公开发售。其中直销机构指本公司的直销中心、网上交易平台和中邮基金官方微信平台一中邮基金服务号,其他销售机构名单详见“五(三)2,其他销售机构”,各销售机构的办理地点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。

6. 本基金首次募集总规模上限为人民币30亿元(即确认的有效认购金额,不含募集期利息),采取“末日比例确认”的方式对上述规模限制进行控制。

7. 投资者欲购买本基金,须开立本公司基金账户。除法律法规另有规定外,一个投资者只能开立和使用一个基金账户,不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

8. 投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他的障碍。

9. 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定生效,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,销售机构应当及时告知投资人其认购的基金名称以及基金份额的确认日期、确认份额和金额等信息,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

10. 本公司仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读刊登在2025年9月26日本公司官方网站的《中邮新锐量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》。

11. 本公告将发布在本公司网站(www.postfund.com.cn)上,投资者可通过本公司网站了解基金发售相关事宜。

12. 在募集期间,除本公司公告所列的销售机构外,如增加其他销售机构,本公司将及时公告或在基金管理人网站列示。

13. 投资人可拨打本公司的客户服务电话400-880-1618及直销专线电话010-82290840咨询购买事宜。

14. 基金管理人可综合各种情况对基金份额的发售安排做适当调整。

15. 风险提示

本基金为混合型证券投资基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金特有的风险

(1) 巨额赎回风险

若本基金发生了巨额赎回,基金管理人有可能采取部分延期支付或暂停支付的措施以应对巨额赎回,因此在巨额赎回情形发生时,基金份额持有人存在不能及时赎回份额的风险。

(2) 资产支持证券投资风险

1) 流动性风险:即证券的流动性下降而给证券持有人带来损失(如证券不能卖出或贬值出售等)的可能性。

2) 证券提前赎回风险:若某些交易赋予SPV在资产支持证券发行后一定期限内以一定价格向投资者收购部分或全部证券的权利,则在市场条件许可的情况下,SPV有可能行驶这一权利从而使投资者受到不利影响。

3) 再投资风险:指证券因某种原因被提前清偿,投资者不得不将证券提前偿付资金再做其他投资时面临的再投资收益率低于证券收益率导致投资者不能实现其参与证券化交易所预计的投资收益目标的可能性。

4) SPV违约风险:在以债务工具(债券、票据等)作为证券化交易载体,即交易所发行的证券系债权凭证的情况下,SPV系投资者的债务人,其应就证券的本息偿付对投资者负责。

(3) 股指期货和国债期货投资风险

本基金可投资股指期货和国债期货,股指期货和国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,标的资产价格微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货和国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规则将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

(4) 股票期权投资风险

本基金的投资范围包括股票期权,股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等,这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

(5) 本基金可以投资港股通标的股票,投资风险包括:

1) 本基金将通过“港股通”投资于香港市场,在市场环境、市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策、市场制度等方面都有一定的限制,而且此类限制可能会不断调整,这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍,从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

2) 香港市场交易规则有别于内地A股市场规则,此外,在港股通下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险:

a. 香港市场实行T+0回转交易,且证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定,因此每日涨跌幅空间相对较大,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动;

b. 只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日,在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险;

c. 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时,联交所将可能停市,投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险;出现境内证券交易所认定的交易异常情况时,境内证券交易所将可能暂停提供部分或者全部港股通服务,投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

d. 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况,所取得的港股通股票以外的联交所上市证券,只能通过港股通卖出,但不得买入,证券交易所另有规定的除外;因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的,可以通过港股通卖出,但不得行权;因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券,可以享有相关权益,但不得通过港股通买入或卖出。

e. 代理投票,由于中国结算在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿,中国结算对投资者设置的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束;投票没有权益登记日的,以投票截止日的持有作为表决权数,投票数量超出持有限额的,按照比例分配持有基数。

f. 汇率风险:投资港股通股票的股票还面临汇率风险,汇率波动可能对基金的投资收益造成影响。

g. 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

(6) 有托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证,可能面临与境内上市交易股票的投资的共同风险,还可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行及交易机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动终止存托凭证持有人的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;存托凭证退市的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(7) 发起式基金存在的风险

本基金将作为发起式基金,在基金募集时,发起资金提供方认购本基金的金额不少于1000万元人民币(不含认购费用),且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年,法律法规和监管机构另有规定的除外。发起资金提供方认购的基金份额持有期限满三年后,发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有,届时,发起资金提供方有可能赎回认购的基金份额。《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,若基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(8) 参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务,可能存在杠杆投资风险和对方交易风险等融资业务特有风险。

(9) 科创板投资风险

本基金可投资于科创板,若本基金投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

(10) 本基金采用量化模型构建投资组合,量化模型仅是选股模型,本基金不采用量化模型进行高频交易。在实际运作过程中,本基金采用量化模型选择股票并构建投资组合,存在失效并导致基金亏损的风险,同时,宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能会影响模型的有效性,无法达到预期投资效果。

(11) 本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。基金管理人提示投资者基金的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

(12) 本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。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资

经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

一、本次募集基本情况

(一) 基金名称
中邮新锐量化选股混合型发起式证券投资基金A/C

基金代码:025486/025487

(二) 基金的类别
混合型证券投资基金

(三) 基金的运作方式
契约型开放式

(四) 基金存续期限
不定期

(五) 基金份额的发售面值
人民币1.00元

(六) 募集上限
人民币30亿元。

(七) 投资目标
在严格控制投资组合风险的前提下,通过量化选股策略精选股票,力争获得超越业绩比较基准的收益。

(八) 投资范围
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证),内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票(简称“港股通股票”),国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)的资产占基金资产的比例为 60% - 95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于本基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,在履行适当程序后,本基金的投资比例会做相应调整。

(九) 发售对象
符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(十) 基金份额发售机构

1) 直销机构
(1) 中邮创业基金管理股份有限公司直销中心

办公地址:北京市东城区北三环东路 36 号环球贸易中心 C 座 20,21 层

联系人:韩伶

电话:010-82290840

传真:010-82294138

网址:www.postfund.com.cn

(2) 中邮基金官方微信平台——中邮基金服务号

(3) 中邮创业基金网上交易平台:https://i.postfund.com.cn/

2) 其他销售机构
中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、光大证券股份有限公司、中银证券华南股份有限公司、国金证券股份有限公司、腾安基金销售(深圳)有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、中信期货有限公司。

上述排名不分先后。

募集期间,如增加其他销售机构,本公司将及时公告或在基金管理人网站列示。

(二) 认购程序与相关规定

(一) 认购费用
本基金 A/C 类基金份额收取认购费用,C类基金份额不收取认购费用。投资人可在募集期内可以多次认购基金份额,适用费率按单笔分别计算。详见基金合同及本招募说明书的相关规定。

(二) 认购份额的计算
本基金 C类基金份额不收取认购费用,A类基金份额认购采用金额的方式,认购金额包括认购费用和净认购金额。

(1) 认购 A 类基金份额的计算
净认购金额 = 认购金额/(1+ 认购费率)

认购费用 = 认购金额 × 认购费率

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息)/基金份额初始面值

对于 500 元(含以上的)认购适用绝对数额的认购费金额。
认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位;认购份额计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。多笔认购时,按上述公式进行逐笔计算。

例:某投资人投资 10,000 元认购本基金 A类基金份额,且该认购申请被全额确认,对应费率 1.2%,如果募集期间内认购资金获得的利息为 2 元, A类基金份额初始面值 1 元,则可得到的 A类基金份额计算如下:

净认购金额 = 10,000/(1+1.2%) = 9,881.42 元

认购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 元

即:认购份额 = (9,881.42 + 2)/1.00 = 9,883.42 元

即:投资人投资 10,000 元认购本基金 A类基金份额,加上认购资金在募集期内获得的利息,可得到 9,883.42 分 A类基金份额。

(2) 认购 C类基金份额的计算
认购份额 = 认购金额/基金份额初始面值

利息转份额:利息/基金份额初始面值

总认购份额 = 认购份额 + 利息转份额

认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位;认购份额计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者投资 100,000 元认购本基金 C类基金份额,且该认购申请被全额确认,假设其认购资金在认购期间产生的利息为 10 元,无认购费用,则其可得到的认购份额为:

认购份额 = 100,000/1.00 = 100,000.00 份

利息转份额 = 10/1.00 = 10.00 份

即:投资人投资 100,000 元认购本基金 C类基金份额,假设其认购资金在认购期间产生的利息为 10 元,则可得到 100,010.00 份 C类基金份额。

(三) 认购申请的确认

基金管理机构对认购申请的受理并不代表该申请一定生效,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

(四) 认购限制

1. 投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

2. 投资者在募集期间内可以多次认购基金份额;A类基金份额的认购以每笔该类基金份额认购申请单独计算,但已受理的认购申请不允许撤销。

3. 投资者通过其他销售渠道认购本基金时,单笔认购金额不得低于 1 元人民币(含认购费),其他销售机构另有规定的,从其规定。基金管理人直销机构接受首次认购申请的最低金额为 10,000 元人民币(含认购费),追加认购的单笔最低金额为 1,000 元人民币(含认购费);通过基金管理人网上交易系统等特定交易方式办理基金认购业务的不受直销机构单笔认购最低金额的限制,首次认购和追加认购的单笔最低金额均为人民币 1 元(含认购费)