

关于调低中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金管理费率 and 托管费率 并修改基金合同等事项的公告

中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年7月18日经中国证监会证监许可[2018]1135号文准予注册，本基金的基金合同于2018年11月29日正式生效。

为更好的满足基金份额持有人的需求，进一步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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定及《中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）决定自2019年5月8日起调低本基金的管理费率及托管费率，并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。具体修改内容如下：

一、 修改内容要点：

1、 本基金拟将基金管理人的管理费由1%年费率调整为0.5%年费率，拟将基金托管人的托管费由0.2%年费率调整为0.1%年费率。

2、 将本基金合同中第十二章，“投资策略”指数编制方案部分，增加“如果指数编制单位变更中证价值回报量化策略指数的编制方案，以指数编制单位公告的最新编制方案为准”，并相应修改选样方法（注：该修改基于中证指数公司于2019年4月2日公告，对中证价值回报量化策略指数编制方案进行了更新，本次变更是因为财政部印发的《关于修订印发2018年度一般企业财务报表格式的通知》对部分会计科目进行归并，对本基金投资范围和投资策略无实质影响）

3、 根据实际情况更新基金托管人的相关信息。

二、 本基金《基金合同》修改要点如下：

“第七部分 基金合同当事人及权利义务” 章节，“二、基金托管人” 部分：

原表述：

（一）基金托管人简况

注册资本：10,685,572,211元人民币

修订为：

（一）基金托管人简况

注册资本：1538722.3983万元人民币

“第十二部分 基金的投资” 章节，“三、投资策略” 部分：

原表述：

1、中证价值回报量化策略指数编制方案

中证价值回报量化策略指数由中邮创业基金管理股份有限公司定制开发，基于价值投资理念，选取投资回报率高且估值相对较低的上市公司股票作为样本股。

(1) 指数名称和代码

指数名称：中证价值回报量化策略指数

指数简称：价值回报

英文名称：CSI Return-based Value Strategy Index

英文简称：Return-based Value

指数代码：930949

(2) 指数基日和基点

该指数以2005年12月30日为基日，以1000点为基点。

(3) 样本选取方法

1) 样本空间

中证价值回报量化策略指数的样本空间由满足以下条件的沪深A股构成：

非ST、*ST股票，非暂停上市股票；

非金融类股票。

2) 选样方法

①根据上市公司最新财务报告的合并报表数据，对股票池中股票提取或计算如下财务数据：应收账款、其他应收款、预付账款、存货、无息流动负债、固定资产、其他权益工具、带息债务、少数股东权益、总市值，并对数据缺失的股票进行处理；

②根据上述财务数据计算资本收益率（ROC）和股票收益率（EY）：

$ROC = EBIT / (\text{净营运资本} + \text{固定资产})$

其中，EBIT为息税前利润，采用过去半年滚动形式计算；

$\text{净营运资本} = \text{应收账款} + \text{其他应收款} + \text{预付账款} + \text{存货} - \text{无息流动负债}$ 。

$EY = EBIT / (\text{总市值} + \text{带息负债} + \text{其他权益工具} + \text{少数股东权益})$

修改为：

1、中证价值回报量化策略指数编制方案

中证价值回报量化策略指数由中邮创业基金管理股份有限公司定制开发，基于价值投资理念，选取投资回报率高且估值相对较低的上市公司股票作为样本股。

如果指数编制单位变更中证价值回报量化策略指数的编制方案，以指数编制单位公告的最新编制方案为准。

(1) 指数名称和代码

指数名称：中证价值回报量化策略指数

指数简称：价值回报

英文名称：CSI Return-based Value Strategy Index

英文简称：Return-based Value

指数代码：930949

(2) 指数基日和基点

该指数以2005年12月30日为基日，以1000点为基点。

(3) 样本选取方法

1) 样本空间

中证价值回报量化策略指数的样本空间由满足以下条件的沪深A股构成：

非ST、*ST股票，非暂停上市股票；

非金融类股票。

2) 选样方法

①根据上市公司最新财务报告的合并报表数据，对股票池中股票提取或计算如下财务数据：应收票据及应收账款、其他应收款（合计）、预付账款、存货、无息流动负债、固定资产（合计）、其他权益工具、带息债务、少数股东权益、总市值，并对数据缺失的股票进行处理；

②根据上述财务数据计算资本收益率（ROC）和股票收益率（EY）：

$ROC = EBIT / (\text{净营运资本} + \text{固定资产}(\text{合计}))$

其中，EBIT为息税前利润，采用过去半年滚动形式计算；

净营运资本=应收票据及应收账款+其他应收款（合计）+预付账款+存货-无息流动负债。

“第十五部分

基金费用与税收”章节，“二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式”部分：

原表述：

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$

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。

2、基金托管人的托管费

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。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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托管费划款指令，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托管人。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。

修改为：

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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托管费划款指令，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托管人。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。

三、托管协议及招募说明书的修订

托管人注册资本在本基金托管协议中一并修改，招募说明书将随后在定期更新时进行相应修改。

四、重要提示

1、上述基金管理费率和托管费率的调整，自2019年5月8日起生效，本基金基金合同及托管协议对应内容相应修改。

2、此次降低管理费率、托管费率及相应修订《基金合同》和其他法律文件属于《基金合同》规定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更《基金合同》的事项，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

3、本公司将在官方网站上公布经修改后的本基金基金合同及托管协议, 招募说明书将在定期更新时相应修改。投资者可通过本公司客服中心或官方网站咨询有关详情。

官方网址：www.postfund.com.cn

客服电话：400-880-1618、010-58511618

4、本公告的最终解释权归本公司所有。

风险提示

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中邮创业基金管理股份有限公司

2019年5月8日

