

关于变更工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额参考净值计算公式及修改基金合同的公告

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》及其它有关法律法规的规定，以及工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同的约定，为了更好的保障基金份额持有人的利益，从完善产品设计、防范产品风险的角度出发，经与基金托管人国信证券股份有限公司协商一致，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定变更本基金的基金份额参考净值计算公式，并修改基金合同相应条款。现将具体变更事项公告如下：

本次修订基金合同“四、基金份额分级——（四）基金份额净值的计算”中基金份额参考净值计算公式条款。

原条款表述为：

“2、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_A = 1.0000 + 1.0000 \times t \times \frac{R}{N}$$

$$NAV_B = \frac{NAV - 0.5 \times NAV_A}{0.5}$$

设 T 日为基金份额参考净值计算日，T=1,2,3……N；

N 为当年实际天数；

t=min{基金合同生效日(含该日)至 T 日(含该日)的实际天数；

最近一个基金份额折算基准日次日(含该日)至 T 日(含该日)的实

实际天数}；

NAV 为 T 日每份工银传媒份额的基金份额净值；NAV_A 为 T 日工银传媒 A 份额的基金份额参考净值；NAV_B 为 T 日工银传媒 B 份额的基金份额参考净值；R 为工银传媒 A 份额约定年基准收益率。

工银传媒份额的基金份额净值、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额参考净值，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。”

修改为：

“2、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_A = \text{Min}(2 \times NAV, 1.0000 + 1.0000 \times t \times \frac{R}{N})$$

$$NAV_B = \text{Max}(0, 2 \times NAV - NAV_A)$$

设 T 日为基金份额参考净值计算日，T=1,2,3.....N；

N 为当年实际天数；

t=min{基金合同生效日(含该日)至 T 日(含该日)的实际天数；最近一个基金份额折算基准日次日(含该日)至 T 日(含该日)的实际天数}；

NAV 为 T 日每份工银传媒份额的基金份额净值；NAV_A 为 T 日工银传媒 A 份额的基金份额参考净值；NAV_B 为 T 日工银传媒 B 份额的基金份额参考净值；R 为工银传媒 A 份额约定年基准收益率。

工银传媒份额的基金份额净值、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额参考净值，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍

五入。国家另有规定的，从其规定。”

本公司将同步更新本基金招募说明书中的相应条款。

注意事项：

1、本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，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。修订后的基金合同自2020年7月6日起生效，届时投资者可登录基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅修订后的基金合同及招募说明书更新。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

2、投资者也可通过以下渠道咨询相关详情：

（1）本公司网站：www.icbccs.com.cn；

（2）本公司客户服务电话：400-811-9999；

3、本公告的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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司

二零二零年七月四日