工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可【2015】595号文注册募集的工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金成立于2015年5月21日。

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》等法律法规的规定和《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》。

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9月24日起，至2020年10月23日17：00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）

3、会议计票日：2020 年 10 月 27 日

4、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：工银瑞信基金管理有限公司工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金持有人大会投票处

地址：北京市西城区德胜门外大街 77 号德胜国际中心 D 座 4 层

邮政编码：100088

联系电话：400-811-9999

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年9月28日，即在2020年9月28日深圳证券交易

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

所交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（http://www.icbccs.com.cn/）下载等方式获取表决票。

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复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或其他经会议召集人认可的业务预留印章等印鉴，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（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、开户证明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、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”的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纸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（三）授权方式 1、纸面方式授权”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。

3、基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（自 2020 年 9 月 24 日起，至 2020 年 10 月 23 日 17：00 止，以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（北京市西城区德胜门外大街 77 号德胜国际中心 D 座 4

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

层），并请在信封表面注明："工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

（二）短信投票（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，自 2020 年 9 月 24 日起，至 2020 年 10 月 23 日 17：00 止（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人提供以下短信通道供投资者进行投票。

基金管理人通过短信平台向已获取手机号码的个人基金份额持有人发送征集投票短信，基金份额持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人基金份额持有人，对机构基金份额持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。

如因上述短信通道或通讯故障等不可抗力或非基金管理人人为因素，导致上述投票短信无法接收到或逾期接收到，短信投票失效，基金管理人不承担责任，基金份额持有人可以选择基金管理人认可的其他投票方式进行投票。

（三）电话投票（仅适用于个人基金份额持有人）

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金管理人于会议投票表决起止时间内（自 2020 年 9 月 24 日起，至 2020 年 10 月 23 日 17：00 止，以基金管理人系统记录时间为准）在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可拨打并按提示转人工坐席，在人工坐席核实基金份额持有人身份后进行电话投票。

基金管理人也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿向基金份额持有人征集表决意见。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话投票的方式仅适用于个人基金份额持有人，对机构基金份额持有人暂不开通。

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基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志，基金份额持有人

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，一份基金份额代表一票表决权。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、基金托管人、销售机构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。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人，或基金托管人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加的受托人名单。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话等其他法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（http://www.icbccs.com.cn/）下载等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人无论通过纸面方式授权还是通过非纸面方式授权的，授权形式及程序均应符合本公告的规定。

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

①个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（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、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），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企业法人营业执照复印件（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、开户证明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明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（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、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）对基金管理人、基金托管人或销售机构的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人、基金托管人或销售机构进行授权的，可通过邮寄授权文件或在基金管理人或受托人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人或受托人营业机构。

基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人、基金托管人或销售机构的柜台办理授权，填写授权委托书，并提交基金份额持有人身份证明文件。投资者通过直销柜台及指定销售机构网点柜台办理基金交易业务时，直销柜台及指定销售机构网点柜台将为投资者提供纸面方式授权的服务。为保护投资者利益，投资者在交易时，不论投资者是否授权或选择何种授权方式，均不影响交易的进行。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可拨打并按提示转人工坐席，在人工坐席核实基金份额持有人身份后进行授权。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金管理人也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话等其他授权的方式仅适用于个人基金份额持有人，对机构基金份额持有人暂不开通。

3、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均表示了具体表决意见的，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，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；若最后时间收到的多次纸面授权均未表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（2）如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（3）如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在有效的其他非纸面方式授权的，以有效的其他非纸面方式的授权为准；

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，以表示具体表决意见的授权为准；最后时间收到的多次授权其授权表示一致的，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（5）如委托人未在授权委托表示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表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（6）如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

4、授权开始时间及截止时间

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为2020年9月24日至2020年10月23日16：30时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或销售机构的指定地址的，授权时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式授权的，授权时间以系统记录时间为准。

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（国信证券股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人大会的审议事项应分别由工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额的基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内具有同等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。2020 年 9 月 24 日前及 2020 年 10 月 23 日 17：00 以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。非纸面方式的表决起讫时间以本公告为准。

（2）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

（3）纸面表决票的效力认定

①纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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如纸面表决票上的表决意见未选、多选或字迹无法辨认或意愿无法判断或表决意见空白的，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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

③如纸面表决票上的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受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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纸面表决票的，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：

i.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；

ii.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；

iii.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，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

七、决议生效条件

1、工银传媒份额、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额在其对应的份额类别内拥有同等的投票权。

2、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额不小于在权益登记日各自类别基金总份额的二分之一（含二分之一）；

3、《议案》应当由经参加大会的工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额基金份额持有人或其代理人所持表决权在各自类别内的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；

4、本基金份额持有人大会决议，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

八、本次大会相关机构

1、召集人：工银瑞信基金管理有限公司

客服电话：400-811-9999

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

联系人：胡金平

联系电话：010-66583052

电子邮件：hu.jinping@icbccs.com.cn

传真：010-66583100

网址：http://www.icbccs.com.cn

2、公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区东水井胡同 5 号北京 INN 大厦五层 A528

联系人：原莹

联系电话：010-85197530

3、见证律师： 上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：(021) 3135 8666

九、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额按照各自的基金份额（参考）净值转换成工银传媒份额的场内份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额将于本公告刊登日当日（2020 年 9 月 24 日）上午开市至上午 10:30 停牌，敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额将在本次基金份额持有人大会计票日自开市起开始停牌，直至基金份额持有

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

人大会决议生效公告日 10:30 复牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市恢复交易。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过工银瑞信基金管理有限公司网站（http://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，投资者如有任何疑问，可致电 400-811-9999 咨询。

5、本公告的有关内容由工银瑞信基金管理有限公司解释。

附件一：《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》

附件二：《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案说明书》

附件三：授权委托书（样本）

附件四：工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

工银瑞信基金管理有限公司

2020年9月24日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件一：

《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人：

由于当前分级基金已不符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及相关监管要求，结合市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关法律法规和《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人国信证券股份有限公司协商一致，提议将工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的投资范围、运作方式、基金费率、基金份额分类方式等事宜进行变更注册，同时修订基金合同，并将本基金更名为“工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）”。《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案说明书》见附件二。

为实施工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的变更方案，提议授权基金管理人办理本次工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更的有关具体事宜，并可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对《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件二：

《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案说明书》

一、　声明

1、结合市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关法律法规和《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定，基金管理人经与基金托管人国信证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》。本次工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更事宜属于实质性调整，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。

2、本次工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案需经参加大会的工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权在各自类别内的三分之二以上（含三分之二）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人，全部有效凭证所代表的工银传媒份额、工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额占权益登记日各自基金总份额的二分之一（含二分之一）以上。

3、基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并在生效后方可执行。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次变更方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案要点

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案的主要内容如下：

（一）更名

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金名称由“工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金”更名为“工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）”。

（二）调整运作方式

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更后，将不再设置基金份额的分级、配对转换和折算机制，运作方式变更为普通契约型开放式。

（三）在本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金工银传媒A份额与工银传媒B份额的终止上市等相关业务。

（四）变更后基金的基本情况

1、基金的名称

工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）

2、基金类型：股票型基金

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金份额的分类：本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

5、基金存续期限

不定期

（五）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制

1、投资目标

采用指数化投资，通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，实现对标的指数的有效跟踪。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、股指期货、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券））、资产支持证券、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

债券回购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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

3、投资策略

本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成分股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%，偏离度年化标准差不超过4%。

（1）股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。

在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

1）法律法规的限制；

2）标的指数成份股流动性严重不足；

3）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；

4）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

5）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。

进行此等替换遵循的原则如下：

1）优先考虑用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；

2）替换后，该成份股票所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重相一致；

3）用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考查期内日收益率序列风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。

（2）股票指数化投资日常投资组合管理

1）标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

2）成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

3）标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

4）申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

5）跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

（3）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（4）股指期货投资策略

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

（5）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（6）其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

4、投资限制

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指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、存出保证金和应收申购款等；

（3）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，不得超过基金资产净值的 10％；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（4）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％；

（5）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％；

（6）本基金管理人管理的全部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％；

（7）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；

（8）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；

（9）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（10）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%，本基金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；

（11）本基金参与股指期货的，应当符合下列要求：在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的20%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的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；

（13）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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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；

（14）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）、（12）、（13）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证传媒指数收益率×95%＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

6、风险收益特征

本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

（六）变更后的基金资产估值

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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，确定公允价值；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值；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，以最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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，调整最近估值价，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括股票等），采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

2、流通受限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债券，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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，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。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

7、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方法估值。

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净值信息的计算结果对外予以公布。

（七）变更后基金的费率水平

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 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

4、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提，计算方法如下：

H=E ×0.02%÷当年天数

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

本基金标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

足一季度的，根据实际天数按比例计算。

标的指数许可使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可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，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月按照指定的账户路径支付上一季度的费用。如指数使用许可协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法或费率。

5、证券账户开户费用：证券账户开户费由基金管理人垫付，运作后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日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（八）变更后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满三个月，可不进行收益分配；

2、本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额收益分配方式为现金分红，场内份额具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国结算公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（九）变更后基金的申购、赎回

1、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及场外其他销售机构办理 A 类基金份额和 C 类基金份额的场外申购和赎回业务。投资人也可使用深圳证券账户，通过场内销售机构利用深圳证券交易所交易系统办理 A 类基金份额的场内申购和赎回业务。基金管理人有权根据实际情况开通 C 类基金份额的场内申购和赎回业务的，具体见基金管理人届时的公告。

办理基金份额场内申购、赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。办理基金份额场外申购、赎回业务的机构为基金管理人直销机构和场外销售机构。

具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

2、申购和赎回的开放日及时间

（1）开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（2）申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

3、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）投资人在场外销售机构赎回基金份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人场外申购的先后次序进行顺序赎回；

（5）办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；

（6）场内申购、赎回需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按照新规定执行；

（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，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、申购与赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

（2）申购和赎回的款项支付

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人在法律法规规定的期限内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、托管行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

（3）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

5、申购与赎回的数额限制

（1）基金申购的限制

场外申购时，投资者通过销售网点每笔申购上述基金的最低金额为 1 元（含申购费）；通过本基金管理人电子自助交易系统申购，每个基金账户单笔申购最低金额为 1 元（含申购费）；追加申购时最低申购限额为 1 元人民币（含申购费）；通过本基金管理人直销柜台申购，首次最低申购金额为 1 元人民币（含申购费），追加申购时最低申购限额为 1 元人民币（含申购费）。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。场内申购时，单笔申购金额最低为 1 元（含申购费），且为 1 元的整数倍。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（2）基金赎回的限制

每次赎回基金份额不得低于 1 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构网点保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。 通过本基金管理人电子自助交易系统赎回，每次赎回份额不得低于 1 份。场内赎回时，赎回份额应当为整数份额。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时，赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

（3）基金管理人不设单个投资人累计持有的基金份额上限，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

（4）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

（5）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

6、申购和赎回的费用及其用途

（1）申购费用

本基金申购采用金额申购方式，A类基金份额申购费率如下表，C类基金份额不收取申购费。投资者在一天之内如果有多笔申购，费率按单笔分别计算。

	申购金额（M）	申购费率
场外申购	M<100 万	1.00%
	100 万≤M<300 万	0.80%
	300 万≤M<500 万	0.60%
	500 万≤M	按笔收取，1000 元/笔
场内申购	深圳证券交易所会员单位应参照场外申购费率设定投资人的场内申购费率。	

本基金A类基金份额的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的市场推广、销售、登记等各项费用。

（2）赎回费用

1）赎回费率按基金份额持有期限递减。各类基金份额的赎回费率如下表：

	A 类基金份额		C 类基金份额	
	持有期限（Y）	赎回费率	持有期限（Y）	赎回费率
场外赎回	Y <7 天	1.50%	Y＜7 天	1.50%
	7 天≤Y <1 年	0.50%		
	1 年≤Y<2 年	0.25%	7 天≤Y<30 天	0.10%
	2 年≤Y	0%	30 天≤Y	0%
场内赎回	Y <7 天	1.50%	-	
	7 天≤Y	0.50%		

注：Y 为持有期限，1 年指 365 天。认购/申购的基金份额持有期限自注册登记系统确认之日起开始计算，自该部分基金份额赎回确认日止，且基金份额赎回确认日不计入持有期。

2）根据有关业务规则，基金份额持有人持有的原工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的工银传媒份额折算转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类份额后，其原基金份额持有期计入工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类份额的持有期；基金份额持有人持有的原工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的工银传媒 A 类份额和工银传媒 B 类份额折算转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额后，基金份额持有期自工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。

（3）基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期限少于 7 天的基金份额持有人，赎回费将全额计入基金财产；对于持有期限不少于 7 天的基金份额持有人，不低于赎回费总额的 25%应归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

（4）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（5）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。

（6）办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金管理人在履行适当程序后按照新规定执行。

（十）变更后基金增设自动终止条款

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。

（十一）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金将安排不少于20个交易日的选择期（具体以基金管理人公告为准）。选择期期间，工银传媒份额只办理赎回业务。工银传媒A份额、工银传媒B份额的交易、配对转换业务照常办理，不受影响。原基金份额持有人可以选择卖出工银传媒A份额、工银传媒B份额、赎回工银传媒份额或者将其持有的工银传媒A份额和工银传媒B份额合并为场内工银传媒份额后再申请赎回。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的工银传媒份额、工银传媒A份额和工银传媒B份额将在份额转换基准日进行转换，原工银传媒份额的场外份额最终将转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外份额，原工银传媒份额的场内份额、工银传媒A份额、工银传媒B份额最终将转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额。

在选择期期间选择赎回的，仍适用工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金仍按照基金合同约定的运作方式进行运作。由于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制、基金份额定期或不定期折算等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十二）基金份额的转换与折算

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日，同日工银传媒A份额、工银传媒B份额终止上市。基金管理人在份额转换基准日将工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的各类基金份额按照本公告的规定分别转换成工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）的A类基金份额的场内份额和场外份额。

本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：1、将工银传媒A份额、工银传媒B份额和工银传媒份额的基金份额（参考）净值均调整为1.0000元；2、在保持基金资产净值总额不变的前提下，分别将基金份额（参考）净值为1.0000元的工银传媒A份额、工银传媒B份额的场内份额和工银传媒份额的场内份额、场外份额转换成份额净值为1.0000元的工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额和场外份额。具体计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

中国证券登记结算有限公司将于折算完成后对基金份额变更登记，其中工银传媒份额的场内份额、工银传媒A份额、工银传媒B份额变更登记为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场内份额。工银传媒份额的场外份额变更登记为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场外份额。

（十三）基金折算转换的特别风险提示

1、工银传媒A份额和工银传媒B份额折算后风险收益特征发生较大变化的风险

工银传媒A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，分级运作期内按基金合同约定获得相应年基准收益率，但在份额折算后，工银传媒A份额持有人原持有的较低风险收益特征的工银传媒A份额将变为较高风险收益特征的工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额为跟踪中证传媒指数的基金份额，无约定年基准收益率的相关安排，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原工银传媒A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

工银传媒B份额具有一定的杠杆属性，表现为高风险、预期收益相对较高的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

特征，但在份额折算后，工银传媒B份额持有人原持有的工银传媒B份额将变为较高风险收益特征的工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额为跟踪中证传媒指数的基金份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原工银传媒B份额持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、工银传媒A份额和工银传媒B份额的流动性风险

工银传媒A份额和工银传媒B份额折算为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额前，工银传媒A份额和工银传媒B份额的持有人有两种方式退出：1）在场内按市价卖出基金份额；2）在场内买入等量的对应份额（即工银传媒A份额持有人买入等量的工银传媒B份额，或者工银传媒B份额持有人买入等量的工银传媒A份额），合并为工银传媒份额，按照工银传媒份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。由于工银传媒A份额和工银传媒B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

3、折算前存在溢价交易的工银传媒A份额和工银传媒B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，工银传媒A份额和工银传媒B份额仍可正常交易。期间，工银传媒A份额和工银传媒B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。由于基金份额转换基准日日终，以工银传媒份额的基金份额净值为基准，工银传媒A份额和工银传媒B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，如果投资者在折算前以溢价买入，折算后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

4、工银传媒A份额和工银传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算转换后发生变化的风险

以工银传媒份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，工银传媒A份额和工银传媒B份额均按各自的基金份额参考净值折算转换为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A 类场内份额，并进行截位取整计算（最小单位为1 份），取整后的余额计入基金资产。因此工银传媒A份额和工银传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算转换后发生变化。由于基金份

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临其所持基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的工银传媒A份额、工银传媒B份额、工银传媒份额场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

（十四）《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）基金合同》的生效及后续安排

自份额转换基准日次日起，基金名称将由“工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金”更名为“工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）”。《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）基金合同生效后，基金管理人将根据相关规定办理工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）的申购赎回等业务。工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）的C类基金份额设置单独的基金代码向投资者销售。详见后续公告。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更方案说明书》以上变更方案要点修订基金合同并实施变更方案。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的历史沿革

工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）由工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更而来。工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金经中国证监会2015年4月8日《关于准予工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]595号文）注册募集，基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金自2015年5月4日至2015年5月15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，《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》于2015年5月21日起正式生效。

（二）基金变更的可行性

1、法律层面不存在障碍

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

根据《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》约定，“终止《基金合同》”、“转换基金运作方式”及“变更基金投资目标、范围或策略”等事项需召开基金份额持有人大会，且“转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效”。本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，特别决议应当经参加大会的工银传媒份额、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额 的基金份额持有人或其代理人所持工银传媒份额、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额各自类别内的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。因此，基金转型不存在法律方面的障碍。

2、基金变更不存在技术障碍

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更后，将进行基金份额变更登记。基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。基金变更不存在技术障碍。

四、基金变更的主要风险及预备措施

（一）变更方案被持有人大会否决的风险，在设计变更方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金变更方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未获得基金份额持有人大会通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将工银传媒A份额与工银传媒B份额按照各自的基金份额（参考）净值转换成工银传媒份额的场内份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

（二）基金变更后运作过程中的相关运作风险，基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金变更后基金运作过程中出现相关操作风险和管理风险。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系：

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

联系电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件三：

授 权 委 托 书

兹委托　　先生 / 女士/机构代表本人（或本机构）出席于 年 月 日召开的工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使本人/本机构于权益登记日所持有的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”）全部基金份额对所有议案的表决权。本授权委托书的有效期为委托人签字或盖章之日起至本基金基金份额持有人大会结束之日止。本人（或本机构）同意被授权人转授权，转授权仅限一次。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人证件号码（填写）：_____

委托人开放式基金账户号/深圳证券账户（填写）：_____

受托人（签字/盖章）：_____

受托人证件号码（填写）：_____

委托日期：　　年　　月　　日

授权委托书填写注意事项:

1. 本授权委托书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。

2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、销售机构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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

决权。

3. 如委托人未在授权委托书表示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表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

4. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购或买入本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件四：

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金份额持有人大会

表决票

<table>
<tr><td colspan="4">基金份额持有人姓名或名称：</td></tr>
<tr><td colspan="4">证件号码(身份证件号/营业执照号)：</td></tr>
<tr><td colspan="4">开放式基金账户/证券账户号：</td></tr>
<tr><td colspan="4">份额类别：
工银传媒份额　【　】
工银传媒A份额 【　】
工银传媒B份额 【　】</td></tr>
<tr><td>审议事项</td><td>同意</td><td>反对</td><td>弃权</td></tr>
<tr><td>关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更相关事项的议案</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">基金份额持有人（或受托人）签名或盖章：

2020年【】月【】日</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">说明：
请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人本开放式基金/证券账户下全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选或字迹无法辨认或意愿无法判断或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权利，委托人本开放式基金账户/证券账户下全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表</td></tr>
</table>

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	决票。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn