

## 工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金 实施转型的公告

工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“我公司”）于2020年9月24日起至2020年10月23日以通讯方式召开了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”）的基金份额持有人大会，审议了《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“本次大会议案”）。本次大会议案于2020年10月27日获得表决通过，自该日起持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。我公司已于2020年10月28日在规定媒介发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于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结果暨决议生效的公告》。根据本次持有人大会的决议，现将实施转型的相关事项公告如下：

**一、本基金转型选择期开始日：2020年10月28日。**

**二、本基金转型选择期终止日：2020年11月24日。**

### **三、关于基金合同等法律文件的修订情况**

根据《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》，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金托管协议》修订为《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定了《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】2054号（《关于准予工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。

### **四、转型方案实施的安排**

本次持有人大会决议生效后，本基金的选择期为2020年10月28日至2020年11月24日。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。

## **五、本基金基金份额的终止上市交易**

基金管理人已按照深圳证券交易所的业务规则和《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定向深圳交易所申请工银传媒A份额与工银传媒B份额的终止上市。具体安排详见基金管理人发布的工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金的终止上市公告。

## **六、本基金基金份额的转换与折算**

本基金的基金份额转换基准日为2020年11月25日。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次大会议案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。

根据《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》，转换后的

银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的申购费率、赎回费率具体如下：

1、A类基金份额申购费率如下表：

	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，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、A类基金份额赎回费率如下表：

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

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。

## 七、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。

#### **八、关于本基金转型后新基金合同的生效**

《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）托管协议》将自2020年11月26日起生效，原《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

本基金转型后的工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF）将增加C类基金份额，C类基金份额向场外投资者销售，届时详见本基金管理人发布的基金合同等法律文件及相关公告。

投资者可登录本基金管理人网站（[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

本公告的解释权归本基金管理人所有。

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

2020年11月20日