

# 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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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【2012】1636号文核准募集的工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）成立于2013年5月28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《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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2016年10月19日起，至2016年11月17日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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2016年10月27日，即在2016年10月27日深圳证券交易所交易结束后，在注册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、复印或登陆基金管理人网站（<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相关的业务专用章，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，但下述第（4）项另有规定的除外；

（4）基金份额持有人使用基金管理人邮寄的专用授权委托书征集信函授权基金管理人投票或通过本公告规定的电话授权方式授权基金管理人、基金托管人（即中国银行股份有限公司）和代销机构投票的，接受有效委托的基金管理人、基金托管人和代销机构应在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件。

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2016年10月19日起，至2016年11月17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层），并在信封表面注明：“基金份额持有人大会表决专用”。

### （二）短信投票

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，自2016年10月19日起，

至 2016 年 11 月 17 日 17:00 以前（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。

如因上行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，导致上行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

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 2016 年 10 月 19 日起，至 2016 年 11 月 17 日 17:00 止）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，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，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自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动生效。

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中国证券登记结算有限责任公司的登记为准。

## （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、代销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。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序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

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）。

如果个人基金份额持有人使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权时，无需提供身份证明文件复印件，在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和具体表决意见，并回寄给基金管理人，该授权委托书即视为有效授权。

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、基金托管人或代销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、基金托管人或代销机构进行授权的, 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、基金托管人或代销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代销机构网点柜台办理基金交易业务时, 直销柜台及指定代销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进行授权。

基金管理人也可主动与基金份额持有人取得联系, 在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后, 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未表示具体表决意见的, 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;

(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、对基金管理人的授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2016 年 10 月 19 日至 2016 年 11 月 17 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、基金托管人或代销机构的指定地址的，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票人在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期第二个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

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。2016 年 10 月 19 日前及 2016 年 11 月 17 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、多选或无法辨认，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。

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、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代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

2、《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更相关事项的议案》应当由提交有效表决票的本基金基金份额持有人（或其受托人）所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；

3、本基金份额持有人大会表决通过的事项，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定的事项自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、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本次持有人大会需要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代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据 2013 年 6 月 1 日生效的《基金法》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的

各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

#### 九、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

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

邮政编码：100010

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

#### 十、重要提示

1、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。

2、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>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电400-811-9999咨询。

3、本基金的首次停牌时间为《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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2016年10月19日）开市起至当日10:30停牌，10:30后恢复交易。本基金第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2016年11月21日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、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：《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更相关事项的议案》

附件二：《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案说明书》

附件三：授权委托书（样本）

附件四：工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

工银瑞信基金管理有限公司

2016年10月19日

附件一：

《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更相关事项的议案》

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，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》和《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）的基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、收益分配原则、费率水平进行变更并修订基金合同，同时将本基金更名为“工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）”。《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案说明书》见附件二。

为实施工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）的变更方案，提议授权基金管理人办理本次工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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《工银瑞信标普全球自然资源指数

证券投资基金（LOF）基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

工银瑞信基金管理有限公司

2016年10月19日

附件二：

《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案说明书》

一、声明

1、考虑到国际原油基金在市场中具有稀缺性，为更好地满足投资者多元化的需求，保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》和《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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中国银行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《关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金

（LOF）变更相关事项的议案》。本次工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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、本次工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人，本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案要点

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更方案的主要内容如下：

### （一）更名

基金名称由“工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）”更名为“工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）”。

### （二）变更后基金的基本情况

#### 1、基金的名称

工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）。

#### 2、基金的类别

基金中基金（FOF）

#### 3、基金的运作方式

上市契约型开放式

#### 4、基金的投资目标

在严格控制组合风险的前提下，投资于境外市场原油基金和原油相关商品类基金（包括ETF），力争为投资者实现对国际市场原油价格走势的有效跟踪。

#### 5、上市交易地点

深圳证券交易所

#### 6、基金存续期限

不定期

### （三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资限制和投资策略

#### 1、投资目标

在严格控制组合风险的前提下，投资于境外市场原油基金和原油相关商品类基金（包括ETF），力争为投资者实现对国际市场原油价格走势的有效跟踪。

#### 2、投资范围

本基金的投资范围包括法律法规允许的、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解

解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生工具；以及中国证监会许可的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：投资于基金（含 ETF）的资产不低于基金资产的 80%，其中投资于原油及原油相关商品类基金的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%（若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行）。

原油及原油相关等商品类基金包括跟踪原油指数、原油期货指数、能源、天然气类商品指数的基金（包括 ETF），或业绩比较基准 90%以上基于原油指数、原油期货指数、能源、天然气类商品指数的基金（包括 ETF）。

当法律法规或监管机构允许基金投资于商品期货或其它品种时，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更上述比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### 3、投资策略

本基金主要通过投资于海外市场原油基金和原油相关商品类基金以实现对原油价格的有效跟踪。本基金不直接买卖或持有实物原油或原油期货合约。

本基金的具体投资策略包括商品类基金投资策略、债券投资策略以及衍生品投资策略三部分组成：

#### （1）商品类基金投资策略

本基金将选择有原油现货、原油期货持仓的商品类基金作为主要投资标的。此类产品持有标准化原油价格合约，可以有效跟踪原油价格。

首先，综合考虑定性及定量两方面因素，形成备选基金库，具体如下：

##### 1) 定性分析：

基金管理人：公司管理该类基金的经验、管理规模、产品线情况；

基金产品：成立时间、投资目标、费率水平、规模情况等；

基金管理团队：团队结构和稳定性、成员职责和从业经历、基金经理管理其它基金的状况；

风险控制：公司风险控制能力、应对重大风险事件的处理能力；

选择运作原油基金时间长，运作成熟，管理规模大的基金管理公司发行的产品，将有利于降低投资组合的投资风险。

## 2) 定量分析：

产品规模：产品规模较大有助于降低跟踪误差和摊薄运作成本，场内产品规模增大还有利于增加流动性；

跟踪误差：衡量基金资产净值（NAV）与跟踪指数的偏离程度，跟踪误差越小，说明该商品基金的投资运作水平越高；

产品跟踪标的：管理人将优先选择与本基金业绩比较基准相同或者相近的基金进行投资，以达到投资目标；

第三方评级机构（如晨星、理柏等）对基金的评级；

流动性：是指场内交易型基金在二级市场交易量的大小以及买卖价差的大小。较高的流动性将有效降低本基金在二级市场买入基金份额时的冲击成本，有利于本基金跟踪效果；

本基金将选取流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、费率低廉、估值基准与本基金的业绩基准间的差异小的原油及原油类商品基金作为主要投资对象，构建备选基金库。

基金管理人将结合备选基金池中对于每只备选基金定性和定量分析的指标进行分析判断，并结合当前市场实际情况进行微调，最后根据计算结果对备选基金进行评估打分。根据评估打分和优选结果确定本基金的投资组合，主要根据基金资产整体在全球不同市场投资的头寸、单个基金历史业绩表现和投资价值等因素综合计算得出单个基金的权重。另外，本基金还可以根据组合的风险特征分析，对单个基金投资比例进行一定调整，以达到风险和收益的最优平衡。

## （2）债券投资策略

由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将投资政府债券、回购等固定收益产品金融工具。债券投资策略总体上服务于基金资产配置，其目的是管理基金的现金资产。

### 1) 久期策略

债券投资主要着眼于中短期投资，以便预期原油市场表现良好时能够迅速调整基金投资组合的资产配置，债券组合的久期不超过 2 年。

### 2) 信用策略

为了控制债券的信用风险，基金持有的债券将主要集中美国、欧洲等成熟市场，且债券发行人所在的国家或地区主权评级不低于投资级。在这些市场，本基金主要投资政府债券，以及其它信用评级将不低于投资级的债券。

### （3）衍生品投资策略

出于回避汇率风险的需要，本基金在有效控制风险的前提下，可以使用外汇互换等衍生金融工具。本基金投资衍生品仅限于投资组合避险或有效管理，不用于投机或放大交易，同时须严格遵守法律法规的其他要求。本基金投资衍生品的主要目的为规避外汇风险规避，不进行外汇汇率的投机交易，但在必要时，可以利用外汇互换等衍生金融工具来管理汇率风险，以规避外币对人民币的汇率风险。

### 4、组合限制

（1）投资于基金（含ETF）的资产不低于基金资产的80%，其中投资于原油及原油相关商品类交易所交易基金的比例不低于非现金基金资产的80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

（2）每只境外基金投资比例不超过本基金资产净值的20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

（3）本基金不得投资于以下基金：

- 1) 其他基金中基金；
- 2) 联接基金（A Feeder Fund）；
- 3) 投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

（4）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%，在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（5）本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的10%。

（6）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

（7）本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。同一机构境内外上市的总股本应当合并计算，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

（8）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%。该非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（9）本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。

（10）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

- 1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信

用评级机构评级。

- 2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。
- 3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
- 4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：
  - ① 现金；
  - ② 存款证明；
  - ③ 商业票据；
  - ④ 政府债券；
  - ⑤ 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。
- 5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。
- 6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

#### （11）金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

- 1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于该基金资产净值的100%。
- 2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
- 3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
  - ① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；
  - ② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；
  - ③ 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
- 4) 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（12）基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

- 1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认

可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(13) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。本项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(14) 中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。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。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的 1-9 条投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，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，但无需基金份额持有人大会审议决定。

## 5、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 购买不动产；

(2) 购买房地产抵押按揭；

- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证;
- (4) 购买实物商品;
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%;
- (6) 利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;
- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易;
- (8) 从事证券承销业务;
- (9) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (10) 从事承担无限责任的投资;
- (11) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (12) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (13) 不公平对待不同客户或不同投资组合;
- (14) 除法律法规规定以外,向任何第三方泄露客户资料;
- (15) 法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

上述禁止行为的设定依据为本基金合同生效时法律法规及监管机关的要求,如果法律法规或监管机关对上述组合限制、禁止行为进行调整的,基金管理人将按照调整后的规定执行,不需经基金份额持有人大会审议。

## 6、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: Brent 原油期货主力合约收益率(汇率调整后)\*45%+ WTI 原油期货主力合约收益率(汇率调整后)\*45%+人民币活期存款收益率(税后)\*10%。

主力合约是当前交易量最大的合约,其转移规则采用彭博资讯的预设规则,即在其交割日所在月份的第一天转移到下一合约。

本基金主要投资于境外市场原油基金和原油相关商品类基金(包括 ETF),力争实现对国际市场原油价格走势的有效跟踪。作为国际油价的重要基准,以 Brent 原油期货合约收益率和 WTI 原油期货合约收益率作为业绩比较基准符合本基金的产品特征。

如果今后法律法规发生变化,或者由于相关原油期货合约发生重大变化等原因导致原油期货主力合约收益率不宜继续作为业绩比较基准,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,在履行适当程序后,本基金可以变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会审议。

## 7、风险收益特征

本基金为基金中基金，主要投资于境外市场原油基金和原油相关商品类基金（包括ETF），力争实现对国际市场原油价格走势的有效跟踪。因此本基金属于证券投资基金中的较高预期风险和预期收益的基金。

#### （四）变更后的基金资产估值

##### 1、基金估值方法

（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

##### 2、股票估值方法

（1）上市流通股股票，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市股票，送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。首次发行且未上市的股票，按成本价估值。首次发行且有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值。

##### 3、债券估值方法

（1）对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘净价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘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，按最近交易日收盘价减去债券最近交易日收盘价中所含的债券应收利息所得到的净价估值。

（2）对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

##### 4、衍生工具估值方法

（1）上市流通衍生工具按估值日当日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市衍生工具按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

##### 5、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

##### 6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、在任何情况下，基金管理人如采用本项 1-6 小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项 1-6 小项规定的方法对基金财产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

9、估值中的汇率选取原则：估值计算中涉及中国人民银行或其授权机构公布人民币汇率中间价的货币，其对人民币汇率以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及其他货币对人民币的汇率，采用指定数据服务商提供的估值日各种货币对美元折算率并采用套算的方法进行折算。

10、对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可以聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

#### （五）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 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### 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 0.28% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### （六）变更后基金的收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

- 1、由于本基金各类基金份额分别以其申购时的币种计价，基金收益分配币种与其对应份额的申购币种相同。本基金同类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、登记在登记结算系统中的基金份额，基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，对某一基金份额类别，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则某一币种的份额相应的以该币种进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按除息日（具体以届时的基金分红公告为准）该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；
- 3、登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。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证券登记结算有限责任公司的相关规定；
- 4、基金收益分配后的每一基金份额净值分别不能低于其面值，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；对于外币申购的份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后外币基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### （七）变更后基金的申购、赎回

本基金同时设立人民币份额和美元份额。人民币份额以人民币计价并进行申购、赎回；美元份额以美元计价并进行申购、赎回。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，设立以其它币种计价的基金份额以及接受其它币种的申购、赎回。以其他外币种类进行基金份额申赎的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

## 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基金份额的场内申购和赎回业务。

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。

具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。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

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要市场的共同交易日，主要市场的定义参见招募说明书，基金管理人公告暂停申购或赎回时除外。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》的有关规定在指定媒介上公告。

### (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。

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》的有关规定在指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、赎回价格以受理申请当日的各类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) “分币种申赎”原则，即以人民币申购获得人民币计价的份额，赎回人民币份额获得人民币赎回款，以美元申购获得美元计价的份额，赎回美元份额获得美元赎回款，依此类推；
- (5) 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；
- (6) 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；
- (7) 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。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

### 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

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。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)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、银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+2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+3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、申购和赎回的数量限制

(1) 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(2) 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(3) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(4) 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》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

### 6、申购和赎回的价格、费用及其用途

#### (1) 申购费

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

费用种类 费率标准

(申购金额M)

人民币份额

场内、场外申购费率 M<100万 1.5%

100万≤M<300万 1.0%

300万≤M<500万 0.8%

M≥500万 按笔收取,1,000元/笔

美元份额

场内、场外申购费率  $M < 10$  万美元 1.5%  
10 万美元  $\leq M < 30$  万美元 1.0%  
30 万美元  $\leq M < 50$  万美元 0.8%  
 $M \geq 50$  万美元 按笔收取, 200 美元/笔

本基金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) 赎回费

场外赎回费率按基金份额持有期限递减。从场内转托管至场外的基金份额, 从场外赎回时, 其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

赎回 赎回费率

场外赎回  $Y < 1$  年 0.50%

1 年  $\leq Y < 2$  年 0.25%

$Y \geq 2$  年 0

场内赎回 0.50%

注:  $Y$  为持有期限, 1 年指 365 天。

(3) 基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担, 其中不低于 25% 的部分归入基金财产, 其余部分用于支付登记费等相关手续费。

(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》的有关规定在指定媒介上公告。

(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申购费率。

(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, 基金合同相应予以修改, 并按照新规定执行, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 7、申购与赎回的登记

(1) 基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

(2) 基金登记机构对投资者的基金份额申购申请确认后，于 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续。投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。以人民币申购的基金份额登记为人民币份额，以美元申购的基金份额登记为美元份额。

(3) 基金登记机构对投资者的基金份额赎回申请确认后，于 T+2 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

(4) 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

(八) 变更后基金的系统内转托管和跨系统转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 1、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理基金份额上市交易的会员单位（交易单元）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照登记机构业务规则的有关规定以及基金销售机构的业务规则。

#### 2、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

(九) 授权基金管理人修订基金合同

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作

管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

#### （十）变更选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金

（LOF）将安排不少于 10 个工作日的选择期。选择期期间，工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）的申购、赎回业务及交易业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）正式实施变更前可选择卖出或赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）份额将默认变更为工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）份额。在选择期期间，由于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）需应对卖出、赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。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。

#### （十一）《工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

自本次持有人大会决议生效后，变更选择期结束之日的次日起，《工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。

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《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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）工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）的历史沿革

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）于 2012 年 12 月 6 日得到证监会募集批复（证监许可【2012】1636 号），基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）自 2013 年 4 月 18 日至 2013 年 5 月 22 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，

《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金合同》于2013年5月28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

根据基金合同约定，“十、基金份额持有人大会——（二）有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规和中国证监会的要求提高该等报酬标准的除外；6、变更基金投资目标、范围或策略；9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项。”

本次持有人大会审议的事项须经一般决议通过，以通讯方式召开。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）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代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

（4）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的其它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）通过。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会按照《基金法》第八十六条的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。

法律法规另有规定的，从其规定。

因此，工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更的方案符合基金合同和有关法律法规的规定。

### 2、基金变更不存在技术障碍

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更后，将进行基金份额变更登记。深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及其深圳分公司和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。

（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等运作风险。

#### 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

附件三：

#### 授权委托书

本人（或本机构）持有了工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）

（以下简称“本基金”）的基金份额，就工银瑞信基金管理有限公司官网www.icbccs.com.cn及2016年10月19日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn/）公布的《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标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

审议事项 同意 反对 弃权

关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更相关事项的议案

本人（或本机构）特此授权 代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份

额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人（或本机构）同意受托人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

委托人证券账户卡号/开放式基金账户号（填写）：

以上表决意见代表委托人本证券账户/开放式基金账户下全部基金份额的表决意见，委托人所持基金份额数以持有人大会权益登记日为准。

签署日期： 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《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）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、代销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。
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书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。

附件四：

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会  
表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号)：

证券账户卡号/开放式基金账户号：

审议事项 同意 反对 弃权

关于工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）变更相关事项的议案  
基金份额持有人（或受托人）签名或盖章：

2016 年 月 日

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，委托人本证券账户/开放式基金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决票。