

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金
实施转型的提示性公告

工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“**我公司**”）于2019年12月24日以现场方式召开工银瑞信睿智中证500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《关于工银瑞信睿智中证500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2019年12月24日获得表决通过，自该日起持有人大会决议生效。我公司已于2019年12月25日在《证券时报》、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn/>）及基金管理人官网（www.icbccs.com.cn）发布《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信睿智中证500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，现将实施变更的相关事项提示如下：

一、本基金转型选择期开始日：2019年12月25日。

二、本基金转型选择期截止日：2020年2月14日。

三、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据《关于工银瑞信睿智中证500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《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金托管协议》修订为《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》，并据此拟定了《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》。上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】520号（《关于准予工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。

《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》将自2020年2月18日起生效，原《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金托管协议》将自同一起失效。

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2019年12月25日至2020年2月14日。

选择期期间，睿智500份额只办理赎回业务。睿智A份额、睿智B份额的交易、合并业务

照常办理，不受影响。原基金份额持有人可以选择卖出睿智A份额、睿智B份额或者赎回睿智500份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的睿智500份额、睿智A份额和睿智B份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额。

在选择期期间选择赎回的，仍适用工银瑞信睿智中证500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，工银瑞信睿智中证500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。由于工银瑞信睿智中证500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睿智中证500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等条款。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。工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同约定，工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金在存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日进行基金的定期份额折算。但如果本次基金的定期份额折算将发生在选择期，基金管理人有权选择不进行定期份额折算，并提前在指定媒介上发布相关公告。

五、本基金基金份额的终止上市交易

基金管理人将按照深圳证券交易所《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳交易所申请睿智A份额与睿智B份额的终止上市。具体安排详见基金管理人届时发布的工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金的终止上市公告。

六、对基金份额持有人的影响及基金变更后风险等级发生变化的风险提示

本基金变更前属于股票型基金，其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外，本基金作为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。睿智A份额具有低风险、低预期收益的特征；睿智B份额具有高风险、高预期收益的特征。

本基金变更后以工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金为主要投资品种，为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金变更后为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

由于基金变更后投资范围、运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，同时不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。变更后，对于原睿智500份额持有人来说，基金的风险收益特征发生了一定的变化。且变更后，原睿智A份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能提高，原睿智B份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能降低。

在工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金正式实施变更前，原基金份额持有人可以选择卖出睿智A份额、睿智B份额或者赎回睿智500份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的睿智500份额、睿智A份额和睿智B份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司

2019年12月25日