

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信睿智深证100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2018年3月14日以现场方式召开工银瑞信睿智深证100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《关于工银瑞信睿智深证100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2018年3月14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2018年3月15日在《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/>）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深证100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：2018年3月15日。

二、本基金转型选择期终止日：2018年4月13日。

三、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据《关于工银瑞信睿智深证100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《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金托管协议》修订为《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定了《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（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【2018】113号（《关于准予工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》将自2018年4月17日起生效，原《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

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2018年3月15日至2018年4月13日。

选择期期间，睿智深证100份额的申购和赎回业务正常办理。深证100A份额、深证

100B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深证100A份额、深证100B份额或者赎回睿智深证100份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的睿智深证100份额、深证100A份额和深证100B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京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）A类基金份额。

在选择期期间选择赎回的，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期限不少于7天的基金份额持有人，仍适用工银瑞信睿智深证100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，工银瑞信睿智深证100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。由于工银瑞信睿智深证100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深证100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。

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、《工银瑞信睿智深证100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深证100A份额与深证100B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深证100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，本基金变更前作为指数型基金，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。

本基金变更前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。深证100A份额具有低风险、低预期收益的特征；深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。

本基金变更后为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金变更后为指数型基金，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。

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，本基金由跟踪深证100指数的分级基金变更为跟踪中证京津冀协同发展主题指数的上市开放式基金，对于原睿智深证100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，原深证100A份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能提高，原深证100B份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能降低。

在工银瑞信睿智深证100分级指数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深证100A份额、深证100B份额或者赎回睿智深证100份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的睿智深证100份额、深证100A份额和深证100B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京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）A类基金份额。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司

2018年3月15日