

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修改 基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自 2018 年 4 月 1 日（含该日）起，投资者赎回时，

对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自 4 月 1 日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（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公司所有。

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

二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、 基金合同修改前后文对照表

章节	修订内容
前言	增加： “、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）”的表述
释义	增加： “《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订”
释义	增加： “流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等”
释义	增加： “摆动定价机制：指当睿智 500 份额遭遇大额申购赎回时，通过调整睿智 500 份额的基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待”
睿智 500 份额基金份额的申购、赎回	“（三）申购与赎回的原则”中，增加： “7、当睿智 500 份额发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，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。”
睿智 500 份额基金	“（五）申购与赎回的数额限制”中，增加：

<p>份额的申购、赎回</p>	<p>“3、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，具体规定请参见相关公告。”</p>
<p>睿智 500 份额基金 份额的申购、赎回</p>	<p>“（七）申购和赎回的费用及其用途”中，修订为： “4、睿智 500 份额的申购费用由申购人承担，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。 睿智 500 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（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，其中对持续持有期少于 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。”</p>
<p>睿智 500 份额基金 份额的申购、赎回</p>	<p>“（九）巨额赎回的认定及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加： “（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。”</p>
<p>睿智 500 份额基金 份额的申购、赎回</p>	<p>“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”之“1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：”中，修订为： “（5）接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时； （6）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的；</p>

	<p>(7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受睿智 500 份额申购申请的措施；</p> <p>(8) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定全部或部分拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。”</p>
<p>睿智 500 份额基金份额的申购、赎回</p>	<p>“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”之“2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：”中，增加：</p> <p>“（5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受睿智 500 份额赎回申请的措施；”</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p>	<p>“名称：工银瑞信基金管理有限公司基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦</p> <p>法定代表人：李晓鹏</p> <p>成立日期：2005 年 6 月 21 日</p> <p>批准设立机关：中国证券监督管理委员会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基金字 2005【93】号</p> <p>经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营”</p> <p>修订为：</p> <p>“名称：工银瑞信基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号</p>

	<p>7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901</p> <p>法定代表人：郭特华</p> <p>设立日期：2005年6月21日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】93号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：400-811-9999”</p>
<p>基金合同当事人及 权利义务</p>	<p>“名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立日期：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：— 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算； 办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券； 买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项 及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款； 外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借 款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买 卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨 询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构 经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令 可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。”</p> <p>修订为：</p>

	<p>“名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整 经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。 存续期间：持续经营”</p>
<p>基金的投资</p>	<p>“（二）投资范围”修改为： “本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-10%。本基金持有的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 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。” “（八）投资禁止行为与限制”之“2、基金投资组合比例限制”</p>

中，增加：

“（2）本基金持有的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 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

.....

（11）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；

（12）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；本基金不受此条款比例限制；

（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；

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（八）投资组合比例调整

“基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述基金投资组合比例限制中第（2）、（11）、（13）项外，因证券市场波动、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投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机

	构另有规定时，从其规定。”
基金资产估值	<p>“（四）估值方法”中，增加：</p> <p>7、当睿智 500 份额发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，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。</p>
基金资产估值	<p>“（六）暂停估值的情形”中，增加：</p> <p>“3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</p>
基金的信息披露	<p>“（六）定期报告”中，增加：</p> <p>“本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。”</p>
基金的信息披露	<p>“（七）临时报告与公告”中，增加：</p> <p>“33、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p> <p>34、当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；”</p>

二、 托管协议修改前后文对照表

托管协议当事人	<p>“名称：王银瑞信基金管理有限公司基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦</p> <p>法定代表人：李晓鹏</p>
---------	---

	<p>成立日期：2005 年 6 月 21 日</p> <p>批准设立机关：中国证券监督管理委员会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基金字 2005【93】号</p> <p>经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营”</p> <p>修订为：</p> <p>“名称：工银瑞信基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901</p> <p>法定代表人：郭特华</p> <p>设立日期：2005 年 6 月 21 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】93 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：400-811-9999”</p>
<p>托管协议当事人</p>	<p>“名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立日期：1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：— 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖</p>

政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理
保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；
国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；
结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖
股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的
发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织
或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的
一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当
地货币；经中国人民银行批准的其他业务。”

修订为：

“名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元
整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办
理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖
政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理
保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；
国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；
结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖
股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的
发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织
或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的
一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当
地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

	<p>存续期间：持续经营”</p>
<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>(一) 依据修改为： “本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）及其他有关法律法规与《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。”</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“2、对基金投融资比例进行监督；”中增加： “（2）本基金持有的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 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； （11）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； （12）本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； （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；本基金管理人承诺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手开展逆回购交易的，可接受质押品的</p>

资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（2）、（11）、（13）项外，因证券市场波动、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投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”