

工银瑞信基金管理有限公司

关于工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告

为更好地满足投资者的需求，提升工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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》的有关规定和《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定转换本基金证券交易模式。现将具体事宜公告如下：

一、证券交易模式转换

自2023年9月4日起，本基金将启动证券交易模式的转换工作。转换后，本基金的证券交易所交易将委托证券公司办理，由证券公司履行交易管理职责。

二、托管协议的修订

因转换证券交易模式，拟对《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）相关条款进行修订，修订内容详见附件。

本次修订不涉及基金合同的修改，已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定。本次证券交易模式转换对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。

三、本基金证券交易模式转换完成以及修订后的《托管协议》生效时间将另行公告。本公司将根据上述修订情况，对《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的相应内容进行修改，并按《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定将更新后的文件在本公司官网上披露。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新、基金产品资料概要等信息披露文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

公司网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金客户服务热线：400-811-9999

五、本公告的解释权归工银瑞信基金管理有限公司。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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

2023年9月1日

附件：《工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金托
管协议修改前后文对照表》

章节	原托管协议 内容	修改后托管协议 内容
五、基金财产的保管	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。</p> <p>(四) 基金证券账户、结算备付金账户的开立和管理</p> <p>3、基金管理人不得对基金证券账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。</p> <p>基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。</p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和<u>证券经纪机构</u>的固有财产。</p> <p>(四) 基金证券账户、<u>证券资金账户</u>的开立和管理</p> <p><u>3、基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立证券资金账户并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。</u></p> <p><u>4、交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开设的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经纪机构负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。</u></p>
六、指令的发送、确认及执行		<p><u>六、指令的发送、确认及执行</u></p> <p><u>基金管理人在运用基金财产时，开展场内证券交易前，基金管理人通过基金托管账户与证券资金账户已建立的第三方存管系统在基金托管账户与证券资金账户之间划款，即银证互转；或由基金托管人根据基金管理人的划款指令执行银证互转。</u></p>
七、交易及清算交收安排	<p>(一) 选择代理证券/期货买卖的证券/期货经营机构</p> <p>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构。</p> <p>基金管理人应代表基金与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议。基金管理人应及时将基金交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人，并根据法律法规要求披露相关内容。</p>	<p>(一) 选择代理证券/期货买卖的证券/期货<u>经纪机构</u></p> <p>基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的<u>证券经纪机构，并与其签订证券经纪合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本基金参与场内证券买卖中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。基金管理人应及时将本基金财产的佣金费率等</u></p>

		<p>基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人，以便基金托管人估值核算使用。</p>
<p>七、交易及清算交收安排</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、资金划拨</p> <p>对于基金管理人的资金划拨指令，基金托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，基金银行账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间和在途时间。在基金资金头寸充足的情况下，基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。对超头寸的划款指令，基金托管人有权止付但应及时电话通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。</p>	<p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、清算与交割</p> <p>(1) 基金投资证券后的清算交收安排</p> <p>本基金通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金其它证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。</p> <p>(2) 证券交易所证券资金结算</p> <p>基金托管人、基金管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司（以下或简称“中登公司”）制定的相关业务规则 and 规定，该等规则和规定自动成为本条款约定的内容。</p> <p>基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定的结算业务规则和规定。</p> <p>证券经纪机构代理本基金财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。</p> <p>对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。</p> <p>(3) 其它场外交易资金结算</p> <p>1) 基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或未及时履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。</p> <p>2) 基金管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖预留印鉴后及时传真给基金托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，基金管理人要书面通知基金托管人。如果时间紧急，管理人可电话通知基金托管人，管理人需在交易完成后及时向托管人补发书面通知。</p> <p>3) 基金管理人发送有效指令（包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令）的截止时间为当天的 15:00，15:00 之后发送的指令，基金托管人会尽力配合，但不能保证当天划款成功。如基金管理人要求当天某一时点到账，则交易结</p>

		<p>算指令需提前 2 个工作小时发送, 并进行电话确认。若因基金管理人原因导致的指令、成交单传输不及时、未能留出足够的操作时间, 致使资金未能及时到账、债券未能及时交割所造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>4) 基金管理人向基金托管人下达指令时, 应确保基金财产托管账户有足够的资金余额, 对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令, 基金托管人可不予执行, 并立即通知基金管理人, 基金托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。基金管理人确认该指令不予取消的, 资金备足并通知基金托管人的时间视为指令收到时间。</p> <p>5) 银行间交易结算方式采用券款对付的, 托管账户与该基金在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨, 除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户的之外, 应当由基金管理人出具资金划款指令, 基金托管人审核无误后执行。由于基金管理人未及时出具指令导致该基金在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失, 基金托管人不承担责任。</p> <p>6) 若基金管理人未及时通知基金托管人有关交易信息, 基金托管人有权 (但并非确保) 仅根据银行间同业市场债券交易成交数据, 主动将基金托管账户中的资金划入银行间同业市场用以完成当日银行间同业市场债券交易的交收, 基金管理人承诺在日终前向基金托管人补出具资金划款指令。</p>
<p>十七、 违约责任</p>	<p>(三) 当事人违约, 给另一方当事人造成损失的, 应就直接损失进行赔偿; 给基金资产造成损失的, 应就直接损失进行赔偿, 另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。如发生下列情况, 当事人应当免责:</p> <p>4、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产, 或交由证券公司公司等其他机构负责清算交收的基金资产 (包括但不限于结算备付金账户内的资金) 及其收益, 由于该机构欺诈、故意、疏忽、过失或破产等原因给本基金资产造成的损失等。</p>	<p>(三) 当事人违约, 给另一方当事人造成损失的, 应就直接损失进行赔偿; 给基金资产造成损失的, 应就直接损失进行赔偿, 另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。如发生下列情况, 当事人应当免责:</p> <p>4、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产, 或交由证券公司公司等其他机构负责清算交收的基金资产 (包括但不限于证券资金账户内的资金) 及其收益, 由于该机构欺诈、故意、疏忽、过失或破产等原因给本基金资产造成的损失等。</p>