工银瑞信基金管理有限公司关于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基金份额持有人大会的第二次提示性公告

工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2019年11月19日在中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn/）、基金管理人官网（www.icbccs.com.cn）和《证券时报》发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于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基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于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基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

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[2011]1541号文核准募集的工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金成立于2012年1月31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《关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》。

1、会议召开方式：现场方式。

2、会议召开时间：2019年12月24日9时30分开始

3、会议召开地点：北京唐拉雅秀酒店

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“《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2019年11月22日，即在2019年11月22日深圳证券交易所交易时间结束后，在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、会议的议事程序和表决方式

1、大会主持人宣布会议开始；

2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有表决权基金份额的总数、占权益登记日基金总份额的比例；

3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；

4、大会主持人公布监票人、公证机关和公证员姓名、见证律师；

5、大会主持人宣读议案；

6、享有表决权的与会人员对议案进行审议，并以投票方式进行表决；

7、监票人在基金份额持有人或代理人表决后立即进行清点，监票人对此进行监督，公证机关对计票过程予以公证；

8、大会主持人当场公布计票结果；

9、公证机关宣读公证词；

10、见证律师发表意见。

五、会议出席对象

1、权益登记日在登记机构登记在册的工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金的基金份额持有人或其代理人。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、基金管理人聘请的见证律师。

5、基金管理人聘请的公证机关人员。

六、基金份额持有人出席会议需要准备的文件

1、个人基金份额持有人出席会议的，需提供本人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件原件及正反面复印件；个人基金份额持有人授权委托他人出席会议并代理行使表决权的，应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

2、机构基金份额持有人出席会议的，需提供该机构开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的加盖公章（或其他经会议召集人认可的业务预留印章等印鉴、下同）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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及代表单位出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及加盖公章的单位授权委托书；合格境外机构投资者出席会议的，需提供授权代表的有效身份证件原件及正反面复印件，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出席会议的其他证明文件，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。机构基金份额持有人委托他人出席本次大会并行使表决权的，应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

七、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，一份基金份额在其对应份额级别内代表一票表决权。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登记机构的登记为准。

（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、销售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。

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开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书；出席的受托人为非法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书和机构授权委托书）。

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开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书；出席的受托人为非法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书和机构授权委托书）。

（2）对基金管理人、基金托管人或销售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、基金托管人或销售机构进行授权的，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、基金托管人或销售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销售机构网点柜台办理基金交易业务时，直销柜台及指定销售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、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额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。

（4）如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

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2019年11月19日至2019年12月23日17时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或销售机构的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

八、会议的预登记

1、预登记时间：2019年11月19日至2019年12月23日，每个工作日上午9:00一一下午4:00。基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

2、现场方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当按照本公告第六条、第七条的规定提供相关资料。

现场方式预登记地址：北京市西城区德胜门外大街77号德胜国际中心D座4层；联系人：胡金平。

3、传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭本公告第六条规定需提供的相关资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为8610-6658 3100，确认电话为400-811-9999，传真收件人为：胡金平。

4、关于预登记的说明：基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备，请各基金份额持有人予以积极配合。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第六条、第七条的规定提供相关资料办理现场会议登记，未能按时依据本公告第六条、第七条的规定及重要提示出示及提供相关资料的，不能入场出席会议并表决。

九、会议召开的条件

1、亲自出席会议者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；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上。

十、计票

1、主持人在会议开始后，宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与基金管理人授权的一名监督员（即基金托管人的委派人员）共同担任监票人。

2、监票人应在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3、如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4、计票过程应由公证机关予以公证，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，不影响计票的效力。参加会议的基金份额持有人或代理人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

十一、决议生效条件

1、睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入进行投票表决的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

3、《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》应当经参加大会的睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过；

4、本基金份额持有人大会决议，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议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。

十二、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要全部有效凭证所代表的睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上；如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，根据《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。

十三、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：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦七层

联系人：黄竞瑶

联系电话：010-65543888

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

十四、重要提示

1、本次会议将于2019年12月24日9时30分召开，届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的公证机关人员以及见证律师将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件提前半小时至会议地点，以便验证入场。主持人宣布会议开始后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

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）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）查阅，投资者如有任何疑问，可致电400-811-9999咨询。

3、本基金睿智A份额与睿智B份额的首次停牌时间为《工银瑞信基金管理有限公司关于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基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2019年11月19日）开市起至当日10:30停牌，10:30后恢复交易。本基金睿智A份额与睿智B份额的第二次停牌的时间为基金份额持有人大会召开之日（2019年12月24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：《关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》

附件二：《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案说明书》

附件三：授权委托书（样本）

工银瑞信基金管理有限公司

2019年11月21日

附件一：

《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》

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：

由于当前分级基金已不符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及相关监管要求，结合市场环境变化，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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关法律法规和《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》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，提议将工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金的基金类别、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，同时修订基金合同，并将本基金更名为“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”。《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案说明书》见附件二。

为实施工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金的变更方案，提议授权基金管理人办理本次工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金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《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》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

2019年11月21日

附件二：

《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案说明书》

一、声明

1、结合市场环境变化，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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关法律法规和《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，决定以现场方式召开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》。本次工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金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、本次工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案需经参加大会的睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）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睿智中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人，全部有效凭证所代表的睿智500份额、睿智A份额与睿智B份额占权益登记日各自基金总份额的50%以上。

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睿智中证500指数分级证券投资基金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、工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案要点

工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金”更名为“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”。

（二）调整运作方式

工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金变更后，将不再设置基金份额的分级、配对转换和折算机制，运作方式变更为普通契约型开放式。

（三）向深圳证券交易所申请工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金睿智A份额与睿智B份额的终止上市及睿智500份额终止场内申购赎回

在本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金睿智A份额与睿智B份额的终止上市、睿智500份额终止场内申购赎回等相关业务。

（四）变更后基金的基本情况

1、基金的名称

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

2、基金类型：ETF联接基金

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金份额的分类：本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用并在赎回时收取赎回费用的，称为A 类份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是在赎回时收取赎回费用并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C 类份额。

5、基金存续期限

不定期

（五）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制

1、投资目标

主要投资本基金目标ETF，采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差的最小化。

2、投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

3、投资策略

（i）资产配置策略

本基金的主要资产将投资于目标ETF份额，该部分资产占基金资产净值的比例不低于90%，本基金不参与目标ETF的投资管理。根据需要，本基金可以投资于标的指数成份股票、备选成份股票，以及非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、同业存单、现金及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，其目的是为了使得本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏差绝对值的年度平均值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（ii）基金投资策略

1、基金组合构建原则

本基金对基金的投资仅限于其指定的目标ETF，现时目标ETF仅指工银瑞信中证500ETF。

2、基金组合的构建方法

在基金合同生效后，本基金将通过以下三种方式构建基金组合，使得投资于目标ETF的资产占基金资产净值的比例不低于90%。

1）以标的指数成分股实物形式申购赎回本基金的目标ETF；

2）在二级市场上买卖本基金的目标ETF，本基金的基金管理人在二级市场上买卖工银瑞信中证500ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

3）以标的指数成分股实物或现金认购本基金的目标ETF。

3、日常组合调整

在基金的日常投资过程中，本基金将主要利用股票组合申购、赎回目标ETF的基金份额，实现指数化投资。根据市场情况，本基金亦可通过二级市场在在证券交易所买入、卖出目标ETF基金份额。三种投资方式主要根据交易成本、市场流动性以及价格的优势决定。

（ⅲ）股票资产投资策略

为了本基金满足申购赎回需要，本基金可以直接投资本基金标的指数的成份股及备选成份股，该部分股票资产投资原则上主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：（1）标的指数成份股流动性严重不足；（2）标的指数的成份股票长期停牌；（3）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

（ⅳ）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，可投资于债券。债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

（ⅴ）资产支持证券投资策略

本基金将投资包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券。本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

（ⅵ）股指期货和权证投资策略

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

4、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；

2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

11）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

12）本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

13） 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

14）本基金参与股指期货交易，在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

15）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资产净值上的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

16） 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；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第1）、2）、10）、15）、16）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数或份股流动性限制、目标ETF申购、赎回、交易被暂停或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。法律法规另有规定的从其规定。

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有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。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。

（2）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）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）买卖除目标ETF外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5）向其基金管理人、基金托管人出资；

6）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；

7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准，不需要经基金份额持有人大会审议，但需提前公告。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

6、风险收益特征

本基金以工银瑞信中证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。

7、目标ETF的变更

目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金：若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

（1）目标ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

（2）目标ETF 终止上市；

（3）目标ETF的基金合同终止；

（4）目标ETF与其他基金进行合并；

（5）目标ETF的基金管理人发生变更；

（6）中国证监会规定的其他情形。

如果未来目标ETF的标的指数发生变更，本基金将相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF，不需另行召开基金份额持有人大会。

（六）变更后的基金资产估值

1、目标ETF的估值

本基金投资的目标ETF按照估值日目标ETF的基金份额净值估值，如该日目标ETF未公布净值，则按该日标ETF的最近公布的净值估值。如果基金管理人认为按上述基金份额净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与基金托管人协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（5）交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。

7、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，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。

9、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金