# 工银瑞信基金管理有限公司
# 关于工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金证券交易模式转换的公告

为更好地满足投资者的需求，提升工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（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《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，本基金证券交易模式进行转换。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。

因转换证券交易模式，对《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）相关条款进行了修订，修订内容详见附件。修订后的《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》已生效。

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。

本公告未尽事宜，敬请投资者参见《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》、《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

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

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12月30日

附件:《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式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<br>内容 | 修改后托管协议<br>内容 |
| --- | --- | --- |
| | 基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司<br>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<br>邮政编码：100033<br>电话：400-811-9999<br>法定代表人：~~王海璐~~<br><br>基金托管人：中信银行股份有限公司<br>住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层<br>邮政编码：100010<br>电话：4006800000<br>传真：010-85230024<br>法定代表人：~~李庆萍~~ | 基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司<br>住所：北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901<br>邮政编码：100033<br>电话：400-811-9999<br>法定代表人：**赵桂才**<br><br>基金托管人：中信银行股份有限公司<br>住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层<br>邮政编码：100010<br>电话：4006800000<br>传真：010-85230024<br>法定代表人：**方合英** |
| **第一条 基金托管协议当事人** | 1.1基金管理人：<br>名称：工银瑞信基金管理有限公司<br>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<br>法定代表人：~~王海璐~~<br>成立时间：2005年6月21日<br>批准设立机关：中国证监会<br>批准设立文号：证监基金字【2005】93号<br>组织形式：有限责任公司<br>注册资本：贰亿元人民币<br>经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务<br>存续期间：持续经营 | 1.1基金管理人：<br>名称：工银瑞信基金管理有限公司<br>住所：北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901<br>法定代表人:**赵桂才**<br>成立时间：2005年6月21日<br>批准设立机关：中国证监会<br>批准设立文号：证监基金字【2005】93号<br>组织形式：有限责任公司<br>注册资本：贰亿元人民币<br>经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务<br>存续期间：持续经营 |

| | | |
|---|---|---|
| | 1.2 基金托管人：<br>名称：中信银行股份有限公司<br>住所：~~北京市东城区朝阳门北大街9号~~<br>法定代表人：~~李庆萍~~<br>成立时间：1987 年 4 月 20 日<br>批准设立文号：国办函[1987]14 号<br>基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125 号<br>组织形式：股份有限公司<br>注册资本：489.35 亿元<br>存续期间：持续经营<br>…… | 1.2 基金托管人：<br>名称：中信银行股份有限公司<br>住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层<br>法定代表人：方合英<br>成立时间：1987 年 4 月 20 日<br>批准设立文号：国办函[1987]14 号<br>基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125 号<br>组织形式：股份有限公司<br>注册资本：489.35 亿元<br>存续期间：持续经营<br>…… |
| 第五条 基金财产保管 | 5.1 基金财产保管的原则<br>5.1.1 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。 | 5.1 基金财产保管的原则<br>5.1.1 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构的固有财产。 |
| | 5.4 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理：<br>5.4.1 基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。<br>~~5.4.2 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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。~~<br>~~5.4.3 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。~~ | 5.4 基金证券账户与证券~~交易~~资金账户的开设和管理：<br>5.4.1 基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。<br>5.4.2 基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。<br>5.4.3 证券账户开立后，基金管理人以本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对应的证券资金账户，并通知基金托管人。证券资金账户用于本基金证券交易的结算以及证券交易结算资金的记录，并与本基金银行账户之间建立唯一银证转账对应关系，证券经纪机构对开立的证券资金账户内存放的资金的安全承担责任，基金托管人不负责保管证券资金账户内存放的资金。<br>5.4.4 由基金托管人持基金管理人与证券经纪机构签订的三方存管相关协议办理证券资金账户与本基金银行账户的银证签约手续，未经基金托管人书面同意，基金管理人不得将银证签约的指定 |

| | | |
|---|---|---|
| | | 银行结算账户（即本基金银行账户）变更为其他账户，否则，因此引起的法律后果及给本基金造成的损失全部由基金管理人承担。<br>5.4.5 本基金证券账户和证券资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户和证券资金账户；亦不得使用本基金的证券账户和证券资金账户进行本基金业务以外的活动。 |
| 第六条 指令的发送、确认和执行 | 6.1 基金管理人对发送指令人员的书面授权<br>…… | 基金管理人在运用基金财产时，开展场内证券交易前，由基金托管人根据基金管理人的划款指令执行基金托管账户与证券资金账户之间划款，即银证互转。<br>基金管理人在运用基金财产时向基金托管人发送场外资金划拨及其他款项收付指令，基金托管人执行基金管理人的指令、办理基金名下的资金往来等有关事项。基金管理人发送指令应采用电子传真、邮件、电子指令或双方认可的其他方式。<br>6.1 基金管理人对发送指令人员的书面授权<br>…… |
| 第七条 交易及清算交收安排 | 7.1 选择证券、期货买卖的证券、期货**经营**机构<br>7.1.1 基金管理人应制定选择证券买卖的证券**经营**机构的标准和程序。基金管理人负责选择本基金证券买卖的证券**经营**机构~~，使用其交易单元作为基金的专用交易单元~~。基金管理人和被选中的证券**经营**机构签订~~交易单元租用协议~~，由基金管理人提前通知基金托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。<br>…… | 7.1 选择证券、期货买卖的证券、期货**经纪**机构<br>7.1.1 基金管理人应制定选择证券买卖的证券**经纪**机构的标准和程序。基金管理人负责选择本基金证券买卖的证券**经纪**机构。基金管理人和被选中的证券**经纪**机构签订**证券经纪服务协议**，由基金管理人提前通知基金托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。<br>…… |
| 七、交易及清算交 | 7.2 基金投资证券后的清算交收安排<br>~~7.2.1 基金管理人和基金托管人在基金清算和交收中的责任~~ | 7.2 基金投资证券后的清算交收安排<br>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 |

| | | |
|---|---|---|
| 收安排 | ~~基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《证券交易资金结算协议》，用以具体明确基金管理人与基金托管人在证券交易资金结算业务中的责任。~~<br>~~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制定的相关业务规则和规定，该等规则和规定自动成为本条款约定内容。基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中国证券登记结算有限责任公司针对各类交易品种制定的结算业务规则和规定。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。~~<br>~~对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并在执行完毕后回函确认，不得延误。本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由基金托管人负责办理。本基金证券投资的清算交割，由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。~~<br>~~如果因基金托管人原因在清算和交收中造成基金财产的损失，应由基金托管人负责赔偿基金的损失；如果因为基金管理人违反法律法规的规定进行证券投资或违反双方签订的《证券交易资金结算协议》而造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后应立即通知基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。~~<br>~~7.2.2基金出现超买或超卖的责任认定及处理程序~~<br>~~基金托管人在履行监督职能时，如果发现基金投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。~~<br>~~7.2.3基金无法按时支付证券清~~ | 算参与人代理本基金进行结算；本基金通过期货经纪机构进行的交易由期货经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。基金管理人、基金托管人以及被选择的证券经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则，签订证券经纪服务协议，用以具体明确三方在证券交易资金结算业务中的责任。<br>对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。<br>本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金汇划，由基金托管人负责办理。<br>证券经纪机构代理本基金财产与中国证券登记结算有限责任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。 |

| | | |
|---|---|---|
| | ~~算款的责任认定及处理程序~~<br>~~基金管理人应确保基金托管人在执行基金管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。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，并及时通知基金管理人。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所需的合理时间，合理时间为2小时。如由于基金管理人的原因导致无法按时支付证券清算款，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。~~<br>~~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、本托管协议的指令不得拖延或拒绝执行。如由于基金托管人的原因导致基金无法按时支付证券清算款，由此给基金造成的损失由基金托管人承担。~~ | |