

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份额发售公告

【本基金暂不向个人投资者公开发售】

重要提示

1、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”)的募集已获中国证券监督管理委员会2020年11月2日证监许可【2020】2856号文注册。中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金是混合型发起式、契约型开放式证券投资基金。

3、本基金的管理人和注册登记机构为工银瑞信基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“工银瑞信”),基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。本基金暂不向个人投资者公开发售,法律法规或监管机构另有规定的除外。

5、本基金将自2020年12月7日至2021年1月7日通过基金管理人指定的销售机构(包括直销机构和其他销售机构)公开发售。

6、本基金的发售渠道为本基金的直销机构。直销机构为本公司直销柜台。

7、投资者欲购买本基金,需开立本公司基金账户。本基金直销机构和指定销售网点同时为投资者办理开立基金账户的手续。投资者的开户和认购申请可同时办理。

8、除法律法规另有规定外,一个投资者只能开设和使用一个基金账户。

9、有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

10、投资者通过其他销售机构网点认购,单个基金账户单笔最低认购金额为1元人民币(含认购费),追加认购每笔最低金额为1元人民币(含认购费),实际操作中,对最低认购限额及交易级差以各销售机构网点的具体规定为准。通过本基金管理人电子自助交易系统认购,每笔最低金额为1元人民币(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元人民币(含认购费)。通过本基金管理人直销柜台认购,单个基金账户的首次最低认购金额为1元人民币(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元人民币(含认购费)。

11、本基金管理人在募集期内实行限量销售,募集规模上限为80亿元(不包括募集期利息,本基金A类基金份额和C类基金份额的募集规模合并计算),并采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制,具体规模控制方案详见本公告“第一部分(七)募集规模限制方案”。

12、销售机构(包括本公司的直销柜台、本公司电子自助交易系统和其他销售机构)对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询。否则,由此产生的任何损失由投资人自行承担。

13、本公司仅对本基金份额发售的有关事项和规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2020年12月4日登载在基金管理人网站(<http://www.icbccs.com.cn>)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.cscc.gov.cn/fund>)上的《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基金合同》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招募说明书》。投资者亦可通过本公司网站下载有关申请表格和了解基金募集相关事宜。

14、销售机构的具体销售网点详见各销售机构的相关业务公告。

15、在募集期间,除本公司所列的销售机构外,如增加或减少销售机构,本公司将及时在基金管理人网站公示。

16、投资者可拨打本公司的客户服务电话400-811-9999咨询认购事宜,也可拨打中信银行客户服务电话(95558)及其他销售机构的客户服务电话咨询认购事宜。

17、对未开设销售网点的地方的投资者,可拨打本公司的客户服务电话400-811-9999咨询认购事宜。

18、基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

19、风险提示

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通投资标的股票”)、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)、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、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)。

待相关监管规定颁布和基础条件具备后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致,并履行适当程序后,参与融资融券业务及投资其他金融衍生品工具(包括但不限于股票期权等),且应当按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的。届时相关事宜将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,并应向投资者履行信息披露义务,但无需基金份额持有人大会审议决定。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%~95%,其中投资于港股通投资标的股票的比例占基金股票资产的比例为0%~50%。权益类多头寸价值减去权益类空头寸价值占基金资产净值比例范围为0%~10%。其中,权益类多头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头寸价值是指卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。在任何交易日终,本基金持有的买入股指期货合约和国债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95%,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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。每个交易日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的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。本基金投资于银行存款和同业存单的比例合计不超过基金资产的20%。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条(一)项、(三)项及第(五)项的限制。

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。

本基金为特殊类型的混合型基金,主要采用对冲策略,与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金,其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性,因此收益不一定能超越业绩比较基准。本基金如果投资港股通投资标的股票,还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、本基金特定风险、本基金主要的流动性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险以及其他风险,详见本基金招募说明书的“基金的风险揭示”章节的具体内容。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托

的具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金,本基金销售机构名单详见本公告以及基金管理人网站。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。本基金初始发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

一、本次募集的基本情况

(一) 基金名称

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 A类份额简称:工银优选对冲灵活配置混合发起 A

A类份额代码:010668

C类份额简称:工银优选对冲灵活配置混合发起 C

C类份额代码:010669

(二) 基金类别和运作方式

混合型发起式证券投资基金。

(三) 契约型开放式

(四) 基金存续期限

不定期。

(五) 基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

(六) 基金发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。本基金暂不向个人投资者公开发售,法律法规或监管机构另有规定的除外。

(七) 销售机构

1、直销柜台

名称:工银瑞信基金管理有限公司
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
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6~9层
公司网址:<http://www.icbccs.com.cn>
全国统一客户服务电话:400-811-9999
基金管理人可根据情况调整销售机构,并在基金管理人网站公示。

(八) 募集规模限制方案

本基金首次募集规模上限为80亿元(不包括募集期利息,本基金A类基金份额和C类基金份额的募集规模合并计算),并采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制,具体规模控制方案详见本公告“第一部分(七)募集规模限制方案”。

12、销售机构(包括本公司的直销柜台、本公司电子自助交易系统和其他销售机构)对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询。否则,由此产生的任何损失由投资人自行承担。

13、本公司仅对本基金份额发售的有关事项和规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2020年12月4日登载在基金管理人网站(<http://www.icbccs.com.cn>)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.cscc.gov.cn/fund>)上的《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基金合同》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招募说明书》。投资者亦可通过本公司网站下载有关申请表格和了解基金募集相关事宜。

14、销售机构的具体销售网点详见各销售机构的相关业务公告。

15、在募集期间,除本公司所列的销售机构外,如增加或减少销售机构,本公司将及时在基金管理人网站公示。

16、投资者可拨打本公司的客户服务电话400-811-9999咨询认购事宜,也可拨打中信银行客户服务电话(95558)及其他销售机构的客户服务电话咨询认购事宜。

17、对未开设销售网点的地方的投资者,可拨打本公司的客户服务电话400-811-9999咨询认购事宜。

18、基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

19、风险提示

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通投资标的股票”)、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)、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、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)。

待相关监管规定颁布和基础条件具备后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致,并履行适当程序后,参与融资融券业务及投资其他金融衍生品工具(包括但不限于股票期权等),且应当按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的。届时相关事宜将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,并应向投资者履行信息披露义务,但无需基金份额持有人大会审议决定。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%~95%,其中投资于港股通投资标的股票的比例占基金股票资产的比例为0%~50%。权益类多头寸价值减去权益类空头寸价值占基金资产净值比例范围为0%~10%。其中,权益类多头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头寸价值是指卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。在任何交易日终,本基金持有的买入股指期货合约和国债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95%,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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。每个交易日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的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。本基金投资于银行存款和同业存单的比例合计不超过基金资产的20%。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条(一)项、(三)项及第(五)项的限制。

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。

本基金为特殊类型的混合型基金,主要采用对冲策略,与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金,其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性,因此收益不一定能超越业绩比较基准。本基金如果投资港股通投资标的股票,还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、本基金特定风险、本基金主要的流动性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险以及其他风险,详见本基金招募说明书的“基金的风险揭示”章节的具体内容。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托

的具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金,本基金销售机构名单详见本公告以及基金管理人网站。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。本基金初始发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

净认购金额 = 10,000 / (1 + 1.2%) = 9,881.42 元

认购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 元

认购份额 = (9,881.42 + 5) / 1.00 = 9,886.42 份

即投资人投资10,000 元认购本基金的A类基金份额,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到9,886.42份A类基金份额。

(2) C类基金份额的认购份额计算方法

投资人按C类基金份额,认购份额的计算方式如下:

认购份额 = (认购金额 + 认购利息) / 认购价格

认购份额(含利息折算的份额)的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人投资10,000元认购本基金的A类基金份额,如果认购期内认购资金获得的利息为5元,则其可得到的A类基金份额计算如下:

认购份额 = (10,000 + 5) / 1.00 = 10,005.00 份

即投资人投资10,000 元认购本基金的C类基金份额,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到10,005.00份C类基金份额。

二、发售方式及相关规定

1、本基金在发售期内面向投资者发售。

2、认购的限额

投资者通过其他销售机构网点认购,单个基金账户单笔最低认购金额为1元人民币(含认购费),追加认购每笔最低金额为1元人民币(含认购费),实际操作中,对最低认购限额及交易级差以各销售机构网点的具体规定为准。通过本基金管理人电子自助交易系统认购,每笔最低金额为1元人民币(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元人民币(含认购费)。通过本基金管理人直销柜台认购,单个基金账户的首次最低认购金额为1元人民币(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元人民币(含认购费)。

3、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个基金账户单笔认购金额进行限制。

4、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个基金账户单笔认购金额进行限制。

5、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个基金账户单笔认购金额进行限制。

6、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个基金账户单笔认购金额进行限制。

7、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个基金账户单笔认购金额进行限制。

8、基金管理人根据基金募集期间投资者认购情况,对单个