

# 泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告

根据有关法律法规规定和基金合同的约定，泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下部分基金可投资科创板股票。可投资于科创板股票的基金列表详见附件一。

现将有关情况说明如下：

1、科创板上市的股票是国内依法上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”；

2、如基金的基金合同所约定的投资范围包括国内依法上市交易的股票，且投资科创板股票符合该基金基金合同所约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例、风险收益特征和相关风险控制指标，对于该等基金产品，本公司将依据法律法规，并履行内部程序后，决定是否参与科创板股票的投资。

3、基金管理人在投资科创板股票过程中，将根据审慎原则，保持基金投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作。

科创板股票具有下列投资风险，敬请基金的投资者注意：

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、技术创新风险、政策风险等。基金可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

投资科创板股票存在的风险包括：

## ①市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

#### ②流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

科创板股票网下发行部分，公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金等配售对象中，10%的最终获配账户将自发行人首次公开发行并上市之日起锁定6个月，基金组合有可能因锁定而无法及时变现。

#### ③退市风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，触发退市的情形更多且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，科创板个股存在退市风险。

#### ④集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

科创板上市企业均为科技创新成长型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

#### ⑤技术创新风险

科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等不达预期的风险。

#### ⑥政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

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，敬请投资人注意投资风险。投资者在办理基金申购、交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书（更新）及相关业务规则等文件。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年6月21日

附件一：可投资科创板股票的证券投资基金列表

序号	基金名称
1	泰达宏利量化增强股票型证券投资基金
2	泰达宏利首选企业股票型证券投资基金
3	泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金
4	泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金
5	泰达宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金
6	泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金
7	泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金
8	泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金
9	泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金
10	泰达宏利定宏混合型证券投资基金
11	泰达宏利风险预算混合型证券投资基金
12	泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金
13	泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金
14	泰达宏利行业精选混合型证券投资基金
15	泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金
16	泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金
17	泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金
18	泰达宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金
19	泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金
20	泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金
21	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金
22	泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金
23	泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金
24	泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金
25	泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金
26	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金
27	泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金
28	泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）
29	泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金
30	泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金
31	泰达宏利宏达混合型证券投资基金
32	泰达宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金