

中融基金管理有限公司关于中融中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金投资于科创板股票相关风险提示的公告

根据有关法律法规规定和《中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）可投资科创板股票。

现将有关情况说明如下：

1、根据《基金合同》的规定，本基金主要投资于标的指数，即中证 500 指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票）。

2、基金管理人将按照《基金合同》的规定，根据审慎原则进行科创板股票投资，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，敬请中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资者注意：

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，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据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但不限于：

1、退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

2、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。

3、流动性风险

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块流动性可能弱于 A 股，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

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。

5、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2020年1月15日