

农银汇理基金管理有限公司

关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北交所上市股票 及相关风险提示的公告

公告送出日期：2021年11月17日

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下部分公开募集证券投资基金可参与北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票的投资。

一、有关情况说明

1. 北交所上市的股票属于《中华人民共和国证券投资基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。

2. 本公司旗下公募基金的基金合同约定投资范围包含“国内依法发行上市的股票”等类似表述的，在遵守各自基金合同约定的投资目标、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等前提下，可参与北交所股票投资。

基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。

3. 本公司在投资北交所股票过程中，将根据审慎原则，做好相关风险管理工作。

二、投资北交所股票的风险

基金投资北交所股票面临上市企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、系统性风险等一系列风险，具体如下：

1. 上市企业经营风险

北交所上市企业主要为创新成长型企业，普遍具有规模小、对技术依赖性强、技术迭代快、议价能力不强等特点，或尚且处于初步发展阶段，业务收入、现金

流及盈利水平等具有较大不确定性。该类企业抗市场风险和行业风险能力较弱，存在较大经营风险，由此可能对基金净值造成不利影响。

2. 股价大幅波动风险

相较于沪/深证券交易所，北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制，股票上市交易首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块，由此可能导致基金净值较大幅度的波动。

3. 企业退市风险

根据北交所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北交所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，基金可能无法及时将该企业股票调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，由此可能对基金净值造成不利影响。

4. 流动性风险

北交所股票投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构投资者持有个股大量流通盘将导致个股流动性较差，若机构投资者在特定阶段对个股形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

5. 系统性风险

北交所上市企业主要为创新成长型企业，其商业模式、盈利风险和业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，由此可能对基金净值造成不利影响。

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，不保证最低收益，也不保证本金不受损失。基金的过往业绩不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对基金业绩表现的保证。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请投资者于投资前认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》及《基金产品资料概要》等法律文件，了解基金的风险收

益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应，注意投资风险。

特此公告。

农银汇理基金管理有限公司

二〇二一年十一月十七日