

恒越基金管理有限公司关于旗下部分公募基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告

根据有关法律法规规定和基金合同的约定，恒越基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下部分公开募集证券投资基金（以下简称“公募基金”）可参与北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票的投资。

现将有关情况说明如下：

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

二、本公司旗下所管理的公募基金可根据各自基金合同的约定，并在遵守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的前提下参与北交所股票的投资。今后，本公司旗下新增公募基金如果符合基金合同的有关规定，亦可以投资北交所上市的股票，届时，本公司可不再另行公告。

三、基金根据投资策略需要或市场环境变化，可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。

四、在投资北交所上市股票过程中，本公司将根据审慎原则，做好相关风险管理工作。

五、风险提示

北交所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。基金投资北交所股票的风险包括但不限于：

（1）上市公司经营风险

由于北交所上市的企业大部分为创新型中小企业，其在持续经营能力、核心技术、管理团队稳定性、财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等方面具有较大的不确定性，由此可能导致投资北交所上市股票对基金净值产生不利影响。

（2）股价大幅波动风险

北交所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北交所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为30%），可能导致较大的股票价格波动。

（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，有可能退出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，可能对基金净值造成不利影响。

（4）流动性风险

北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北交所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，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

北交所上市公司主要属于创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。

（6）监管规则变化的风险

北交所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）等法律文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

恒越基金管理有限公司

2022年8月10日