

关于兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划 可投资科创板股票及相关风险揭示的公告

兴证证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）旗下兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合资产管理计划”）的资产管理合同等法律文件于2021年11月15日生效。合同生效后，根据有关法律法规规定和本集合资产管理计划合同的约定，本集合资产管理计划可投资科创板股票，现将相关事宜进行说明。

一、有关情况说明：

1、科创板上市的股票是国内依法上市的股票，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、本集合资产管理计划，合同中的投资范围包括“国内依法发行上市的股票”，在遵守资产管理合同所规定的投资目标、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，可参与科创板股票的投资。

3、本集合资产管理计划可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分集合资产管理计划资产投资于科创板股票或选择不将集合资产管理计划资产投资于科创板股票，本集合资产管理计划并非必然投资于科创板股票。

4、管理人在投资科创板股票过程中，将根据审慎原则，保持集合资产管理计划投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作。

二、风险提示：

集合资产管理计划财产投资于科创板股票，会面临科创板因投资标的、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、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策及宏观环境风险等。

投资科创板股票存在的风险包括但不限于：

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管理企业，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，资产管理计划组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

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，且科创板的退市标准比 A 股其他板块更为严格，违反相关规定的科创板上市公司将直接退市，没有暂停上市和恢复上市两方面程序，科创板个股存在更高的退市风险。

④系统性风险

科创板企业均为科技创新企业，在企业经营及盈利模式上可能存在趋同，所以科创板个股价格相关性可能较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

⑤政策及宏观环境风险

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，科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则的修改、或新的法律法规和业务规则的出台，均可能对科创板股票投资带来政策风险。此外，国内宏观经济环境、国际经济形势变化等宏观环境因素也可能对战略新兴产业及科创板个股带来影响。

管理人将在届时更新产品招募说明书时相应调整重要提示及风险揭示部分。

风险提示：本管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划财产，但不保证投资于集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。产品的过往业绩不代表未来表现，投资有风险，敬请投资人认真阅读集合资产管理计划的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

兴证证券资产管理有限公司

2021 年 11 月 15 日