

上海国泰君安证券资产管理有限公司

关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告

根据有关法律法规规定和基金合同的约定,上海国泰君安证券资产管理有限公司(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股票的投资。

一、有关情况说明

北京证券交易所上市的股票属于《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”。

本公司旗下公募基金的基金合同约定投资范围包括“国内依法发行上市的股票”、“依法发行上市的股票”等类似表述的,在遵守基金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,可参与北京证券交易所股票的投资。

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京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于北京证券交易所股票,基金资产并非必然投资于北京证券交易所股票。

本公司在投资北京证券交易所股票过程中,将根据审慎原则,做好相关风险管理工作。

二、风险提示

基金资产投资于北京证券交易所股票,会面临北京证券交易所机制下因投资标的、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:

1. 上市企业经营风险

北京证券交易所上市企业为创新型中小企业,其持续经营能力,核心技术,经营管理团队稳定性,财务数据稳定性存在较高的不确定性,企业应对外部政策、市场变化的能力较弱,可能面临一定的经营风险。因此,基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时,须承受北京证券交易所上市中小企业不确定性更大的风险,基金投资于北京证券交易所上市企业面临无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。

2. 股价大幅波动风险

北京证券交易所股票涨跌幅限制比例区间相对较大,股票上市的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,可能导致较大的股票价格波动。

3. 企业退市风险

北京证券交易所上市企业可能会触及相关法律法规、证监会以及北京证券交易所规定的退市情形,可能面临被终止上市的风险,进而可能对基金净值造成不利影响。

4. 流动性风险

北京证券交易所投资门槛较高,初期参与的主体可能较少,流动性可能弱于A股其他板块;此外,由于北京证券交易所上市企业规模小,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. 集中度风险

北京证券交易所为新设交易所,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。

6. 监管规则变化的风险

北京证券交易所相关法律、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。

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。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。

投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》(更新)和基金产品资料概要(更新)等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。

特此公告。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

2021年11月17日