

广发基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告

根据有关法律法规规定和基金合同的约定,广发基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下部分基金可投资科创板股票。目前本公司旗下可投资科创板股票的基金列表详见附件一。

现将有关情况说明如下:

科创板股票依据相关法律法规公开发行人并在上海证券交易所科创板上市交易,是国内依法发行上市的股票,符合《证券投资基金法》及中国证监会规定的基金可投资的范围。因此,本公司旗下所管理的部分公募基金(详见附件一)可根据各自基金合同的约定,本着谨慎和风险可控的原则,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的前提下参与科创板股票投资。

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,包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、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:

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。

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参与证券交易满两年并且证券账户及资金账户内的资产在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，基金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，科创板个股存在退市风险。

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。

自本公告发布之日起，本公司后续成立的公募基金可根据各自基金合同的约定，本着谨慎和风险可控的原则，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的前提下参与科创板股票投资。届时，本公司可不再另行公告。

本公司在科创板股票投资过程中，将根据审慎原则，保持基金投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作，切实保护好基金投资者利益。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2019年6月21日

附件一：可投资科创板股票的证券投资基金列表

序号	基金名称
1	广发稳健增长开放式证券投资基金
2	广发小盘成长混合型证券投资基金 (LOF)
3	广发聚丰混合型证券投资基金
4	广发策略优选混合型证券投资基金
5	广发大盘成长混合型证券投资基金
6	广发核心精选混合型证券投资基金
7	广发聚瑞混合型证券投资基金
8	广发行业领先混合型证券投资基金
9	广发制造业精选混合型证券投资基金
10	广发消费品精选混合型证券投资基金
11	广发新经济混合型发起式证券投资基金
12	广发轮动配置混合型证券投资基金
13	广发新动力混合型证券投资基金
14	广发睿毅领先混合型证券投资基金
15	广发沪港深行业龙头混合型证券投资基金
16	广发中小盘精选混合型证券投资基金
17	广发估值优势混合型证券投资基金
18	广发双擎升级混合型证券投资基金
19	广发睿阳三年定期开放混合型证券投资基金
20	广发稳健策略混合型证券投资基金
21	广发港股通优质增长混合型证券投资基金
22	广发养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)
23	广发聚安混合型证券投资基金
24	广发聚宝混合型证券投资基金
25	广发聚泰混合型证券投资基金
26	广发稳裕保本混合型证券投资基金
27	广发鑫瑞混合型证券投资基金 (LOF)
28	广发价值回报混合型证券投资基金
29	广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)
30	广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
31	广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金
32	广发聚优灵活配置混合型证券投资基金
33	广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金
34	广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金
35	广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金
36	广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金
37	广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金
38	广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金
39	广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金
40	广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

41	广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金
42	广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金
43	广发多策略灵活配置混合型证券投资基金
44	广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金
45	广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金
46	广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金
47	广发稳安灵活配置混合型证券投资基金
48	广发安享灵活配置混合型证券投资基金
49	广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金
50	广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金
51	广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金
52	广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金
53	广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金
54	广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金
55	广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金
56	广发安盈灵活配置混合型证券投资基金
57	广发再融资主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
58	广发多因子灵活配置混合型证券投资基金
59	广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
60	广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金
61	广发新兴成长灵活配置混合型证券投资基金
62	广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金
63	广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金
64	广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金
65	广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
66	广发龙头优选灵活配置混合型证券投资基金
67	广发趋势动力灵活配置混合型证券投资基金
68	广发聚富开放式证券投资基金
69	广发沪港深新机遇股票型证券投资基金
70	广发沪港深新起点股票型证券投资基金
71	广发多元新兴股票型证券投资基金
72	广发医疗保健股票型证券投资基金
73	广发高端制造股票型发起式证券投资基金
74	广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金
75	广发品牌消费股票型发起式证券投资基金
76	广发资源优选股票型发起式证券投资基金
77	广发科技动力股票型证券投资基金
78	广发消费升级股票型证券投资基金
79	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
80	广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
81	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
82	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
83	广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金

84	广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金
85	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
86	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
87	广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金
88	广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金
89	广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
90	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
91	广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
92	广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金
93	广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金
94	广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
95	广发中证医疗指数分级证券投资基金
96	广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)
97	广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金
98	广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
99	广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金
100	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
101	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
102	广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金
103	广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金
104	广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金
105	广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金
106	广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
107	广发中证建设工程指数型发起式证券投资基金
108	广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
109	广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金
110	广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金
111	广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
112	广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金
113	广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
114	广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金 (QDII)
115	广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金