

国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金可参与科创板投资及相关风险揭示的公告

根据《证券投资基金法》、《上海证券交易所科创板股票上市规则》及其配套文件的相关规定，现就国海富兰克林基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下部分基金可参与科创板投资的相关事宜公告如下：

科创板上市的股票是国内依法发行上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。本公司旗下所管理的证券投资基金将根据各自基金合同的约定，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前提下参与科创板投资。本公司旗下可参与科创板投资的基金列表如下：

序号	基金代码	基金全称
1	000065	富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金
2	000761	富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金
3	000934	富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金
4	001392	富兰克林国海金融地产灵活配置混合型证券投资基金
5	001605	富兰克林国海沪港深成长精选股票型证券投资基金
6	002087	富兰克林国海新机遇灵活配置混合型证券投资基金
7	002361	富兰克林国海恒瑞债券型证券投资基金
8	005552	富兰克林国海新趋势灵活配置混合型证券投资基金
9	005652	富兰克林国海天颐混合型证券投资基金

10	006039	富兰克林国海估值优势灵活配置混合型证券投资基金
11	006373	富兰克林国海全球科技互联混合型证券投资基金(QDII)
12	164508	富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金
13	450001	富兰克林国海中国收益证券投资基金
14	450002	富兰克林国海弹性市值混合型证券投资基金
15	450003	富兰克林国海潜力组合混合型证券投资基金
16	450004	富兰克林国海深化价值混合型证券投资基金
17	450005	富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金
18	450007	富兰克林国海成长动力混合型证券投资基金
19	450008	富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金
20	450009	富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金
21	450010	富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金
22	450011	富兰克林国海研究精选混合型证券投资基金
23	457001	富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金

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，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险等。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但不限于：

1、公司治理风险。科创板股票发行实行注册制，上市条件与主板不同，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，可能存在表决权差异安排。

## 2、流动性风险：

由于参与科创板投资有一定的门槛要求，科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险。

科创板可能采用摇号抽签方式对于参与网下申购中签的账户进行获配股份的一定时间内的锁定机制，锁定期期间获配的股份无法进行交易，存在流动性风险。

## 3、退市风险。科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格：

(1) 退市情形更多。当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形，将直接导致退市；

(2) 退市时间更短。因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序，因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形；

(3) 执行标准更严。当上市公司明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入时，可能会直接导致退市。

4、股价波动风险。科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%。

5、境外企业风险。在境外注册的红筹企业可以发行股票或存托

凭证在科创板上市，其在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。

6、存托凭证特别风险。存托凭证代表境外基础证券权益，但持有人并不等同于直接持有境外基础证券。

7、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。

8、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。

我司承诺在投资科创板股票过程中，根据审慎原则，保持基金投资风格的一致性，做好流动性风险管理工作，切实保护好基金投资者的利益，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益，敬请投资人注意投资风险。投资者在办理基金申购、交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书（更新）及相关业务规则等文件。

特此公告。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019年6月21日