

# 上海东方证券资产管理有限公司关于东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金可投资科创板股票的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)及相关法律法规的规定和基金合同的约定,上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。
- 2、本基金的基金合同约定的投资范围中包括国内依法上市的股票,且投资科创板股票符合本基金的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。
- 3、基金管理人在投资科创板股票过程中,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等工作。
- 4、基金管理人将在本基金更新的招募说明书中相应调整重要提示及风险揭示章节。
- 5、基金可根据投资策略需要或市场环境变化,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。

## 二、风险揭示

敬请投资者注意,基金投资国内上市的科创板股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于如下特殊风险:

### 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。大多数企业或为初创型公司,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。

### 2、股价波动风险

科创板个股上市前五个交易日无涨跌停限制,第六个交易日开始涨跌幅限制在正负 20%以内,股价可能表现出比 A 股其他板块更为剧烈的波动。

### 3、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,存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

### 4、退市风险

科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准,退市时间更短,退市速度更快,退市情形更多,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市可能会对基金净值产生不利影响。

### 5、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。

### 6、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。

### 7、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股票也会带来政策影响。

如有疑问，投资者可登录公司网站：[www.dfham.com](http://www.dfham.com) 或拨打客户服务热线：400-9200-808 咨询。

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，基金的过往业绩不代表未来表现，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解基金的详细情况，请于投资基金前认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书及相关业务规则等文件。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

特此公告。

上海东方证券资产管理有限公司

2019年8月12日