

东方阿尔法基金管理有限公司关于东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金可投资于科创板股票的公告

根据相关法律法规规定和基金合同的约定，东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金可投资于科创板股票。现将有关事项公告如下：

- 1、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”。
- 2、东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金基金合同中的投资范围包括国内依法发行上市的股票，投资科创板股票符合该基金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工作。

科创板股票具有下列投资风险，敬请投资者注意：

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，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、投资集中的风险、系统性风险、股价波动风险、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但不限于：

1、退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，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的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

2、市场风险

科创板股票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，科创板股票市场风险加大。

3、流动性风险

由于科创板股票投资门槛高，整体板块流动性可能弱于A股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，将会造成较大的流动性风险。

对于参与科创板新股网下申购中签的获配账户，将通过摇号抽签方式确定一定的比例进行锁定，锁定期间获配的股份无法进行交易，存在一定程度的流动性风险。

4、投资集中的风险

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

因科创板上市企业均为科技创新成长型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。

6、股价波动风险

因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大。科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制。首次公开发行上市的

科创板股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，第 6 个交易日开始涨跌幅限制在正负 20%以内。因此，导致科创板股票上市后可能存在股价波动较大的风险。

7、政策风险

国家对高新技术产业扶持力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。

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，敬请投资人注意投资风险。投资者在办理基金申购等交易相关业务前，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。

东方阿尔法基金管理有限公司

2019 年 9 月 19 日