

# 嘉实基金管理有限公司 关于旗下部分公募基金 参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告

根据有关法律法规规定和基金合同的约定,嘉实基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下部分公开募集证券投资基金(以下简称“基金”)可参与北京证券交易所股票的投资。

## 一、有关情况说明

1、北京证券交易所上市的股票是国内依法发行上市的股票,属于《基金法》第七十二条规定的“上市交易的股票”。

2、本公司旗下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。

3、在投资北京证券交易所股票过程中,本公司将根据审慎原则,保持基金投资风格的一致性,并做好流动性风险管理工作。

## 二、投资风险提示

北京证券交易所主要服务于创新型中小企业,在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易所存在差异,基金投资北京证券交易所股票的风险包括但不限于:

### (1) 上市公司经营风险

由于北京证券交易所上市的企业大部分为创新型中小企业,其在持续经营能力、核心技术、管理团队稳定性、财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等方面具有较大的不确定性,由此可能导致投资北京证券交易所上市股票对基金净值产生不利影响。

### (2) 股价大幅波动风险

北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别,包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制(上市后的首日不设涨跌幅限制,其后涨跌幅限制为30%),可能导致较大的股票价格波动。

### (3) 退市风险

北京证券交易所上市公司可能会触及北京证券交易所规定的退市情形,导致其股票存在被终止上市风险,给基金净值带来不利影响。

### (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;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) 系统性风险

北京证券交易所上市公司主要属于创新成长型企业,其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似,因此基金难以通过分散投资来降低风险,若股票价格同向波动,将引起基金净值较大波动。

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、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。

嘉实基金管理有限公司  
2021年11月16日