

金鹰基金管理有限公司

关于旗下基金参与北京证券交易所 股票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,金鹰基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下部分基金可投资北京证券交易所(以下简称“北交所”)股票。

对有关情况及相关风险公告如下:

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《中华人民共和国证券投资基金法》第七十二条规定的“上市交易的股票”。

2、本公司旗下所管理的、投资范围包括境内/国内依法发行上市的股票等类似表述的公募基金,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北交所股票投资。

基金管理人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北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票,基金资产并非必然投资于北交所股票。

3、自本公告发布之日起,若本公司后续成立的基金符合法律法规要求和基金合同的有关约定,亦可以投资北交所发行上市的股票,届时本公司可不再另行公告。

4、基金管理人在北交所股票投资过程中,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。

二、风险提示:

北交所股票具有下列投资风险,敬请投资者注意:

基金资产投资于北交所股票,会面临北交所机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括上市公司经营风险、流动性风险、退市风险、股价大幅波动风险、转板风险、系统性风险、政策风险等。投资北交所股票存在的风险包括但不限于:

(1)上市公司经营风险:由于北交所上市公司大部分为创新成长型企业,其持续经营能力,核心技术、经营、管理团队稳定性,财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等风险的水平上具有较大的经营风险,由此可能导致基金持仓股价的较大负向波动。

(2)流动性风险:由于北交所股票的投资者门槛较高,二级市场上个人投资者参与度相对较低;同时北交所为新设全国性证券交易所,初期可投标的较少,投资者容易集中投资于少量个股。机构持有个股大量流通盘可能导致个股流动性较差,基金组合存在无法及时变现的风险和其他相关流动性风险。

(3)退市风险:北交所上市公司可能会触及北交所规定的退市情形,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)股价大幅波动风险:北交所在证券发行、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,包括北交所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制(上市交易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。

(5)转板风险:北交所上市公司在满足相关法律法规和监管部门规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的,可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功,均可能引起基金净值波动。

(6)系统性风险:北交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:北交所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则可能根据市场情况进行修改完善,或者补充制定新的法律法规和业务规则。上述变化可能对基金投资运作产生影响,或导致基金投资运作相应调整变化。

本基金管理人承诺以诚实信用、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。投资有风险,决策须谨慎。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。

投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、《产品资料概要》、《招募说明书》及其更新文件等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司
2022年1月19日