

睿远基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票及相关风险提示的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定,睿远基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下公开募集证券投资基金(以下简称“基金”)可投资北京证券交易所(以下简称“北交所”)股票。

一、有关情况说明

1、北交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、本公司旗下基金根据基金合同约定可投资上市交易股票的,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指标等前提下,可参与北交所股票的投资。

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、基金管理人在投资北交所股票过程中,将根据审慎原则,并做好流动性风险管理工作。

今后,本公司旗下新增基金如果符合基金合同的有关规定,亦可以投资北交所上市的股票。届时,本公司不再另行公告。

二、风险提示

北交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场所存在差异,基金投资北交所股票的风险包括但不限于:

1、中小企业经营风险

北交所上市企业主要为创新型中小企业,该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点,抗市场风险和行业风险能力较弱,存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险;另一方面,部分中小企业可能尚处于初步发展阶段,业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性,个股投资风险较大。

2、股价大幅波动风险

北交所所在证券发行、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。同时北交所股票交易存在盘中临时停牌情形,设有异常波动股票核查制度。

3、退市风险

根据北交所退市制度,上市企业退市情形较多,一旦所投资的北交所上市企业进入退市

流程,有可能退出新三板创新层或基础层挂牌交易,或转入退市公司板块,基金可能无法及时将该企业调出投资组合,从而面临退出难度较大、流动性变差和变现成本较高的风险,可能对基金净值造成不利影响。

4、流动性风险

北交所投资门槛较高,个人投资者参与度相对较低;由于北交所上市企业规模小,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。此外,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,市场可能存在高集中度状况。基金可能面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

5、系统性风险

北交所上市公司主要属于创新型中小企业,其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似,因此基金可能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。

6、监管规则变化的风险

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,可能对基金投资运作产生影响。

7、发行风险

发行人发行承销过程中,出现预计发行后总市值无法满足招股文件所选上市标准的,将按规定终止发行。公开发行股票并上市时,发行人和主承销商可以采用超额配售选择权。这或导致基金投资运作产生变化。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书(更新)、基金产品资料概要等信息披露文件,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,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

特此公告。

睿远基金管理有限公司

2022年11月22日