

## 鑫元基金管理有限公司

# 关于旗下公开募集证券投资基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告

根据有关法律法规规定，鑫元基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金（以下简称“公募基金”）将按照各自基金合同的约定，可参与科创板股票的投资。

现将有关情况说明如下：

1、科创板上市的股票是国内依法发行、上市的股票，属于《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、本公司旗下管理的公募基金基金合同约定投资范围包括“国内依法发行或上市的股票”、“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，可参与科创板股票的投资。

自本公告发布之日起，本公司后续成立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科创板股票投资。届时，本公司可不再另行公告。

3、本公司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，切实保护好基金投资者利益。

**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，包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中度风险、市场风险、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）科创板股票的流动性风险

科创板投资门槛较高,个人投资者需要满足一定条件才可参与科创板股票投资,科创板股票流动性可能弱于其他市场板块。若机构投资者在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,存在股票无法成交的风险。

#### (2) 科创板企业退市风险

科创板有更为严格的退市制度,退市时间更短,退市情形更多,执行标准更严,且不设暂停上市、恢复上市和重新上市环节,科创板上市企业退市风险更大,可能给基金带来不利影响。

#### (3) 投资集中度风险

科创板为新设板块,初期可投标的较少,投资者可能集中投资于少量个股,同时,因科创板上市企业均为科技创新成长型,市场可能存在高集中度状况且价格波动趋同的情况,若股票价格同向波动,将引起基金净值波动,整体存在集中度风险。

#### (4) 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。科创板个股上市前五日无涨跌幅限制,第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内,个股波动幅度较其他股票加大,市场风险随之上升。

#### (5) 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。

#### (6) 股价波动风险

科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向,询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式,询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者,而个人投资者无法直接参与发行定价。同时,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股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。

#### （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个股也会带来政策影响。

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。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。本公司提醒投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》（更新）和基金产品资料概要（更新）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。

鑫元基金管理有限公司

2024 年 7 月 13 日