

# 汇丰晋信基金管理有限公司关于汇丰晋信中小盘低波动策略股票型 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汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同的约定，本基金可投资于科创板股票。

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《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。
2. 本基金的基金合同中的投资范围包括国内依法发行上市的股票，且投资科创板股票符合本基金的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，将根据审慎的原则，保持基金投资风格的一致性，并做好流动性风险管理等工作。

科创板股票具有下列投资风险，敬请本基金的投资者注意：

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、集中度风险、系统性风险、政策风险、其他风险等。本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：

一、退市风险

- (一) 科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格；
- (二) 退市情形更多：当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形，将直接导致退市；

(三) 退市时间更短：因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序，因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形；

(四) 执行标准更严：当上市公司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时，可能会直接导致退市。

## 二、市场风险

(一) 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；

(二) 科创板个股上市前五日无涨跌停限制，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。

## 三、流动性风险

(一) 由于参与科创板投资有一定的门槛要求，科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险；

(二) 科创板可能采用摇号抽签方式对于参与网下申购中签的账户进行获配股份的一定时间内的锁定机制，锁定期间获配的股份无法进行交易，存在流动性风险。

## 四、集中度风险

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。

## 五、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。

## 六、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。

## 七、其他风险

(一) 公司治理风险。科创板股票发行实行注册制，上市条件与主板不同，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，可能存在表决权差异安排；

(二) 境外企业风险。在境外注册的红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市，其在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异；

(三) 存托凭证特别风险。存托凭证代表境外基础证券权益，但持有人并不等同于直接持有境外基础证券。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对新基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。敬请投资人在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇二〇年八月十四日