

新疆前海联合基金管理有限公司

关于旗下部分公开募集证券投资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

根据有关法律法规和基金合同的约定，新疆前海联合基金管理有限公司（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“公募基金”）可参与北京证券交易所（以下简称“北交所”）股票投资，现将有关情况及相关风险揭示说明如下：

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》第七十二条第（一）款规定的“上市交易的股票”。

2. 本公司旗下公募基金的基金合同约定可投资上市交易的股票的，在遵守基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征和相关风险控制指标等前提下，可参与北交所股票投资。

公募基金可根据投资策略需要或市场环境变化，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. 本公司将根据审慎原则进行北交所上市股票投资，并做好流动性风险管理工作，切实保护好基金份额持有人的利益。

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、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征和相关风险控制指标等前提下参与北京证券交易所股票投资。届时，本公司可不再另行公告。

二、北京证券交易所股票投资风险揭示

基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、流动性风险、股价大幅波动风险、退市风险、转板风险、系统性风险、集中度风险和监管规则变化风险、政策风险等：

1. 上市公司经营风险

北交所上市企业主要为创新成长型企业，普遍具有规模小、对技术依赖性强、技术迭代快、议价能力不强等特点，或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。该类企业抗市场风险和行业风险能力较弱，存在较大经营风险，个股投资风险加大，由此可能对基金净值造成不利影响。

2. 流动性风险

北交所股票投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构投资者持有个股大量流通盘将导致个股流动性较差，若机构投资者在特定阶段对个股形成一致预期，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。

3. 股价大幅波动风险

相较于沪/深证券交易所，北交所竞价交易设置了更宽的涨跌幅限制，股票上市交易首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块，由此可能导致基金净值较大幅度的波动。

4. 退市风险

北交所上市公司可能在后续经营期间触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，导致其股票存在被终止上市的风险，从而给基金净值带来不利影响。

5. 转板风险

北交所上市公司在满足相关法律法规和证监会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、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动，系统性风险将更为显著。

7. 集中度风险

北交所为新设全国性证券交易所，初期可投资标的较少，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。

8. 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订和完善，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，或导致基金投资运作相应调整变化。

9. 政策风险

国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对专精特新产业及北交所个股也会带来政策影响。

风险提示：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。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者在投资前认真阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，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。

特此公告。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇二四年六月四日