

# 华泰证券（上海）资产管理有限公司

## 关于旗下华泰紫金周周购3个月滚动持有债券型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

根据相关法律法规规定和基金合同约定，华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）就旗下华泰紫金周周购3个月滚动持有债券型证券投资基金可投资科创板股票的相关事宜说明如下：

一、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》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。

二、本公司旗下所管理的华泰紫金周周购3个月滚动持有债券型证券投资基金投资于科创板股票符合基金合同约定的投资范围、投资目标、投资策略、资产配置比例、风险收益特征和相关风险控制指标的，可以直接投资科创板股票，也可以通过投资科创板企业发行的可转债转股后间接投资科创板股票。

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。

三、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，做好流动性风险管理。

### 四、风险提示

基金资产投资科创板股票，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：

#### （一）退市风险

- 1、科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；
- 2、退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；
- 3、执行标准更严，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的上市公司可能会被退市；
- 4、不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

#### （二）市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术产业和战略新兴产业，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，股票投资市场风险加大。同时，科创板股票竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制（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%），且科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

### （三）流动性风险

科创板投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，整体流动性可能相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

### （四）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，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

### （五）监管规则变化的风险

科创板股票相关法律、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，导致基金投资运作产生相应调整变化。

### （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股票也会带来政策影响。

基金投资于科创板上市股票，可以分享科创板上市公司发展带来的收益，也可能承担因科创板风险而造成的基金财产损失。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。投资者在办理基金申购等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书(更新)及相关业务规则等文件，全面了解各基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场。

特此公告。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2021 年 3 月 12 日