
上海东方证券资产管理有限公司

关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）及相关法律法规的规定和基金合同的约定，上海东方证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金可投资科创板股票，现将相关事宜进行说明。

一、有关情况说明

1、科创板上市的股票是国内依法上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。

2、上述基金的基金合同约定的投资范围均包括国内依法上市的股票，且投资科创板股票符合上述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。

4、基金管理人将在上述基金更新的招募说明书及基金产品资料概要中相应调整重要提示及风险揭示部分。

5、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。

6、本公司将来新成立的公开募集证券投资基金，如其基金合同中的投资范围包括国内依法发行上市股票的，也可投资于科创板股票，届时不再另行公告。

二、风险揭示

敬请投资者注意，基金投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

1、科创板股票股价波动较大的风险。

科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他板块更为剧烈的波动。

2、科创板股票退市的风险。

科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，可能会对基金净值产生不利影响。

3、科创板股票流动性较差的风险。

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体活跃度可能弱于 A 股其他板块；科创板机构投资者占比较大，股票存在一致性预期的可能性高于 A 股其他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的风险。

4、科创板上市公司在商业模式、盈利模式等方面可能存在一定相似性，因此，基金所持有的科创板股票股价存在同向波动的可能，在市场表现不佳时可能对基金净值产生不利影响。

如有疑问，投资者可登录公司网站：www.dfham.com 或拨打客户服务热线：400-9200-808 咨询。

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，基金的过往业绩不代表未来表现，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解基金的详细情况，请于投资基金前认真阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及相关业务规则等文件。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

特此公告。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 4 月 8 日