

华菁证券有限公司关于旗下集合资产管理计划

可投资科创板股票的公告

根据有关法律法规规定和资产管理合同的约定，华菁证券有限公司（以下简称“本公司”或“管理人”）就旗下已成立的华菁海纳百川股票多策略1号集合资产管理计划（以下简称“本集合”或“本产品”）可投资科创板股票的相关事宜进行说明。

现将有关情况说明如下：

1、科创板上市的股票是国内依法上市的股票，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”及《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十七条第二项规定的“上市公司股票”；

2、本集合的资产管理合同中的投资范围中含上市公司股票（包括在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的股票、在全国中小企业股份转让系统（简称：新三板）挂牌转让的证券、通过网上申购和/或网下申购的方式参与新股配售和增发和港股通标的股票），且投资科创板股票符合本集合的资产管理合同及说明书所约定的投资目标、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、管理人在投资科创板股票过程中，将根据审慎原则，保持投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作。

科创板股票具有下列投资风险，请本产品的投资者特别关注：

资产管理计划财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，包括但不限于市场风险、流动性风险、股价波动风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。资产管理计划可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分资产管理计划财产投资于科创板股票或选择不将资产管理计划财产投资于科创板股票，资产管理计划财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）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。大多数企业或为初创型公司，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。

（2）股价波动风险

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，股价可能表现出比A股其他板块更为剧烈的波动。

（3）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（4）退市风险

科创板执行比A股其他板块更为严格的退市标准，退市时间更短，退市速度更快，退市情形更多，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公

司退市可能会对资产管理计划净值产生不利影响。

（5）集中度风险

科创板为新增板块，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。

（6）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。

（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股票也会带来政策影响。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例，敬请投资者注意投资风险。投资者在办理认/申购等相关业务前，应仔细阅读本产品的资产管理合同、说明书、风险揭示书及相关业务规则等文件，关注合格投资者和适当性管理相关规定，确认为合格投资者并提前做好风险测评，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。

华菁证券有限公司

2019年7月17日

