广发基金管理有限公司关于旗下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

根据有关法律法规规定和基金合同的约定，广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下部分基金可投资北京证券交易所股票。

现将有关情况说明如下：

北京证券交易所股票依据相关法律法规公开发行并在北京证券交易所上市交易，是国内依法发行上市的股票，符合《证券投资基金法》及中国证监会规定的公募基金可投资的范围。因此，本公司旗下所管理的投资范围包括境内/国内依法发行上市的股票等类似表述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的前提下参与北京证券交易所股票投资。

基金资产投资于北京证券交易所股票，会面临北京证券交易所机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括上市公司经营风险、流动性风险、退市风险、净值波动幅度风险、集中度风险、系统性风险等。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北京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于北京证券交易所股票，基金资产并非必然投资于北京证

券交易所股票。

投资北京证券交易所股票存在的风险包括：

（1）上市公司经营风险：由于北京证券交易所上市公司大部分为创新成长型企业，其持续经营能力，核心技术、经营、管理团队稳定性，财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等风险的水平上具有较大的经营风险，由此可能导致基金持仓股价的较大负向波动。

（2）流动性风险：由于北京证券交易所股票的投资者门槛较高，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，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（3）退市风险：北京证券交易所上市公司可能会触及北京证券交易所规定的退市情形，导致其股票存在被终止上市风险，给基金净值带来不利影响。

（4）净值波动幅度风险：北京证券交易所股票涨跌幅限制比例大于包括创业板和科创板在内的A股其他板块，可能给基金净值带来较大的波动风险。

（5）集中度风险：北京证券交易所为新设全国性证券交易所，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：北京证券交易所上市公司主要属于创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基

金净值较大波动。

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的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。

本公司在北京证券交易所股票投资过程中，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，切实保护好基金投资者利益。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2021年11月15日