

申万菱信基金管理有限公司 关于申万菱信沪深300优选指数增强 发起式证券投资基金参与科创板投资 及相关风险提示的公告

根据有关法律法规及基金合同的约定,申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”)就申万菱信沪深300优选指数增强发起式证券投资基金(简称“本基金”,基金代码A/C:016103/016104)参与科创板投资的相关事宜说明如下:

一、科创板股票是指依法发行上市的股票,符合《中华人民共和国证券投资基金法》及中国证监会规定的基金投资范围。

二、本基金可根据基金合同的约定,本着谨慎性的原则,在遵守基金合同所规定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的前提下参与科创板股票的投资。

三、风险提示

科创板股票相比A股其他板块股票,将承担因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有的风险,包括但不限于:

1、科创板股票的上市标准与A股其他板块存在较大差异,未对企业盈利水平有强制要求;此外,科创板以成长型的科技型企业为主,由于投入规模大、技术迭代快、盈利周期长等行业特点,科创板企业的收入及盈利水平具有较大不确定性,可能存在上市后持续无法盈利的情形;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企业会带来政策影响;

2、科创板新股采用向机构投资者询价的方式确定发行价格且可比公司较少,发行定价难度大,上市后存在股价较大波动的风险;

3、科创板退市制度与A股其他板块股票更为严格,退市时间更短,退市情形更多,执行标准更严,且不再设置退市缓冲期和退市风险警示环节;

4、科创板股票交易设置较低的涨跌幅限制,首次公开发行上市的股票,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%,可能产生股价大幅波动的风险;

5、科创板投资者门槛较高,流动性可能弱于A股其他板块,且机构投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,将会造成较大的流动性风险;

6、科创板可能采用摇号抽签方式对资金与网下申购中签的账户进行获配股份的一定时间内的锁定机制,锁定期间获配的股份无法进行交易,存在流动性风险;

7、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。

8、其他风险

(1)公司治理风险。科创板股票实行注册制,上市条件与主板不同,科创板上市公司的股权激励制度更为灵活,可能存在表决权差异安排;

(2)境外企业风险。在境外注册的红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市,其在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异;

(3)存托凭证特别风险。存托凭证代表境外基础证券权益,但持有人并不等同于直接持有境外基础证券。

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本资产损失。本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2022年12月27日

申万菱信沪深300优选指数增强发起式证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2022年12月27日

1 公告基本信息

基金名称	申万菱信沪深300优选指数增强发起式证券投资基金
基金简称	申万菱信沪深300优选指数增强发起式
基金代码	016103
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月26日
基金管理人名称	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
基金类型	指数型基金
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》,及其配套法规,《申万菱信沪深300优选指数增强发起式证券投资基金招募说明书》
下属分级基金的基金简称	申万菱信沪深300优选指数增强发起式A
下属分级基金的交易代码	016103
下级基金的交易代码	016104

2 基金募集情况

基金募集申请向中国证监会核准的文号	证监许可[2022]169号
基金募集期间	自2022年12月21日 至2022年12月26日止
验资机构名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
募集金额人/托管金额人/管理人/托管金额人/管理人	2022年12月26日
基金募集金额(元)	430,000,000.00

份额面值(元)

申购金额(元)

认购金额(元)

募集金额(元)

认购金额(元)

募集金额(元)