

兴证证券资产管理有限公司

关于旗下部分集合计划参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告

根据有关法律法规规定和资产管理合同的约定，兴证证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）旗下部分集合计划可参与北京证券交易所的股票投资。

一、有关情况说明：

1、北京证券交易所上市的股票属于《中华人民共和国证券投资基金法》第七十二条规定的“上市交易的股票”。

2、本公司旗下部分集合计划（详见附件一）可根据各自资产管理合同的约定，在遵守资产管理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等前提下，可参与北京证券交易所股票的投资。

3、上述集合计划根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分集合计划资产投资于北京证券交易所股票或选择不将集合计划资产投资于北京证券交易所股票，集合计划资产并非必然投资于北京证券交易所股票。

4、在投资北京证券交易所股票过程中，本公司将根据审慎原则，做好相关风险管理工作。

二、风险提示：

北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，集合计划投资北京证券交易所股票的风险包括但不限于：

1、中小企业经营风险

由于北京证券交易所上市的企业大部分为创新型中小企业，该类企业在持续经营能力、核心技术、管理团队稳定性、财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等方面具有较大的不确定性，由此可能导致投资北京证券交易所上市股票对集合计划净值产生不利影响。

2、股价大幅波动风险

北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。

3、企业退市风险

根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，集合计划可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对集合计划净值造成不利影响。

4、流动性风险

北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致集合计划面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

5、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，因此集合计划难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起集合计划净值较大波动。

6、监管规则变化的风险

北京证券交易所相关法律、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，可能对集合计划投资运作产生影响，或导致集合计划投资运作相应调整变化。

风险提示：本管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划财产，但不保证投资于集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。产品的过往业绩不代

表未来表现，投资有风险，敬请投资人认真阅读集合资产管理计划的相关法律文件，并选择
适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

兴证证券资产管理有限公司

2023年12月19日

附件一：可投北京证券交易所股票的集合计划列表

序号	产品全称
1	兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划
2	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划
3	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划
4	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划
5	兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划
6	兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划
7	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型集合资产管理计划