

# 上证国企100交易型开放式指数证券投资基金

## 投资风险提示书

为使投资者更好地了解投资上证国企100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的风险,根据有关证券交易法律法规和证券交易所业务规则,特制定本风险提示书。本风险提示书并不能完全揭示上证国企100交易型开放式指数证券投资基金交易的全部风险,投资者应充分考虑投资可能发生的风险。

### 一、重要提示

1、本风险提示书并不能揭示从事本基金交易的全部风险,我们将保留修改本风险提示书的权利。投资者务必对此有清醒的认识,认真考虑是否进行本基金的相关业务;

2、本基金的募集与上市经中国证监会核准,但中国证监会的核准并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险;

3、基金管理人以往的经营业绩,不代表本基金的未来业绩;基金管理人除尽诚信的管理义务外,不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金的最低收益。

### 二、投资人投资本基金,主要存在以下特定风险:

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离:

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率,产生正的跟踪偏离度。

(4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(5) 由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费和托管费的存在,使基金

投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(6) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### **4、标的指数变更的风险**

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### **5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险**

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### **6、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险**

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### **7、退市风险**

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### **8、投资者申购失败的风险**

因本基金在申购、赎回清单可能不会对所有的成份股允许使用现金替代，而且现金替代比例会设置现金替代上限比例进行控制。所以投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法购入申购所需的足够成份股，导致申购失败的风险。

#### **9、投资者赎回失败的风险**

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### **10、基金份额赎回对价的变现风险**

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

### 11、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

(2) 登记结算机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

### 12、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

### 13、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

### 14、不可抗力因素导致的风险

不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，不可抗力包括但不限于地震、火灾、水灾、战争、电力和通讯故障、系统故障、网络黑客攻击、设备故障、罢工、政府行为或政策法规变化等。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

### 15、其他风险

由于投资人密码失密、操作不当、投资决策失误等原因发生的可能损失由投资人自行承担；在投资人进行证券交易中他人做出的保证获利或不会发生亏损的任何承诺都属于无效承诺。

## 三、通过证券公司进行本基金交易的特定风险

投资者在进行本基金的申购、赎回或其他交易时，证券公司作为本基金的参与券商，负责传送申请数据，但申请数据的最终确认结果由基金管理公司、交易所、登记过户机构负责。对由以下原因造成的后果，参与券商不承担任何责任：

1、投资者未完整、真实地填妥各类申请表的内容，或未附上所需要的全部资料；

- 2、因不符合本基金基金合同和招募说明书规定的条件而使各类申请无效；
- 3、由于基金管理公司、交易所、登记过户机构的过失，造成损害结果的发生；
- 4、其它非由参与券商承担责任的情况，如突发性的通讯、设备故障，自然灾害及其它不可抗力因素等。

#### 四、其他相关约定

- 1、投资者用于申购基金份额一篮子股票的托管份额以交易所托管份额为准；
- 2、投资者在进行申购、赎回业务操作时，如果发生现金替代或现金差额的情况，代理销售机构有权从投资人资金账户中划扣应补缴金额，若资金账户余额不足，投资者应在 3 个工作日之内补足相应欠款。若投资者没有在规定时间内补足欠款，代理销售机构有权按照欠款金额将投资者账户内相应证券进行抵扣，或保留追讨的权利。欠款账户不得办理撤指定、转托管或销户手续。
- 3、投资者在进行申购、赎回业务操作时，代理销售机构有权根据客户当天本基金交易的规模，在客户账户中按照交易规模 10%的比例设定“禁取资产”额度，“禁取资产”在相应交易完成前可用不可取。

中银基金管理有限公司

签署日期：\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

#### 投资者申明

本人/本机构已认真阅读本《风险提示书》，理解所提示的风险，并愿意承担投资风险给本人/本机构造成的损失。

投资者（签名）：

签署日期：\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日