

关于主投北交所股票的公募基金风险评级说明

考虑到集中投资于北京证券交易所（以下简称“北交所”）上市的股票可能给基金带来一系列特有风险，如流动性可能弱于 A 股其他板块、股价涨跌幅限制大于其他 A 股板块等，进而使基金持有人面临较大的净值波动风险。因此，我们从落实投资者适当性管理制度以及保护投资者利益角度出发并经过审慎评估，决定将主投北交所股票的公募基金持仓风险定为 4 分，即当此类基金成立不满三年时，基金综合风险等级为 R4（中高风险），待成立满三年后，基金综合风险等级将根据业绩波动情况进行动态调整。该规则将于 2024 年 4 月 30 日正式生效。

感谢您的关注与支持！

致礼。并颂商祺

Morningstar 晨星（中国）研究中心

2024 年 4 月 24 日