

风险揭示书

一、中欧创业板两年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由中欧基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照有关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2020]1209号文注册。《中欧创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)和《中欧创业板两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”或“招募说明书”)已通过本公司网站(www.zofund.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)进行了公开披露。

二、本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经

营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

四、本基金 A 类基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。C 类基金份额不上市交易。

五、本基金投资创业板上市企业，会面临创业板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括退市风险（创业板执行更为严格的退市标准）、股价波动风险（创业板股票的涨跌幅限制更大因此可能会带来更大的波动）、投资战略配售股票风险（战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

六、基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

七、基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股，存在不对港股进行投资的可能。

八、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管

理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

九、为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

十、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

十一、本基金每 2 年开放一次，每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。每个开放期的首日为基金合同生效日的每 2 年年度对日，若该日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日。

本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，本基金的基金份额可在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下上市交易。

开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期开始前 2 日进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间

中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求。

十二、本基金的投资策略包括大类资产配置策略、战略配售投资策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略及融资、转融通证券出借业务投资策略。具体策略内容详见本基金《基金合同》和《招募说明书》。

十三、本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 60%（在开放期前一个月和后一个月以及开放期内基金投资不受该比例限制），且投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，其中基金投资于创业板股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。开放期每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。

十四、投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《中欧创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

本基金风险揭示书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

十五、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

十六、投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告及基金管理人官网披露的基金销售机构名录。