

# 中国国际金融股份有限公司关于债券普通投资者参与公司债/企业债认购及交易相关风险揭示的公告

尊敬的投资者：

2022年5月23日，《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》（2022年修订）、《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》（2022年修订）（以下简称《债券适当性管理办法》）正式实施。根据《债券适当性管理办法》的要求，中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）拟对开通上海证券交易所、深圳证券交易所公司债券、企业债券认购及交易权限的普通投资者进行相关风险揭示，公告如下：

为了便于您进一步的了解债券市场的风险，根据有关债券交易的法律、法规、规章、规则以及《债券适当性管理办法》，特以公告方式向您提供本风险揭示。

## 一、总则

您从事债券交易的风险包括但不限于如下几个方面：信用风险、市场风险、流动性风险、放大交易风险、政策风险及其他各类风险。

## 二、投资者适当性

您应当根据自身的财务状况、实际需求、产品认知能力和风险控制与承受能力，以及内部制度（若为机构投资者），审慎决定参与相应类型的债券交易。

## 三、信用风险

信用风险也称违约风险，指债券发行人不能按时向债券持有人还

本付息而给债券持有人造成损失的可能性。造成违约风险的直接原因是债券发行人财务状况恶化，最严重的是债券发行人破产。如果您购买或持有资信评级较低的信用债，将面临显著的信用风险。

#### 四、市场风险

市场风险是债券投资活动中最普通、最常见的风险，市场风险是由于市场环境或供求关系等因素导致的债券价格波动的风险。由于国家宏观经济形势的变化以及周边国家、地区宏观经济环境和周边债券市场的变化，可能引起债券市场价格波动，并可能给您造成经济损失。

#### 五、流动性风险

流动性风险是指投资者在短期内无法以合理价格买入或卖出债券，从而面临的变现或投资困难，或不能在适当或期望的价格上变现或投资，而使您遭受损失的风险。

#### 六、放大交易风险

放大交易风险是指投资者利用现券和回购两个品种进行债券投资的放大操作，从而放大投资损失的风险。

#### 七、政策风险

由于国家法律、法规、政策、交易所规则的变化、修改等原因，可能引起债券市场价格波动，将可能会对您的交易产生不利影响，甚至给您造成经济损失。

#### 八、其他风险

若出现诸如地震、台风、火灾、水灾、战争、瘟疫、社会动乱等不可抗力因素可能给您造成经济损失。同时，由于无法控制和不可预

测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障、卫星传送中断等可能导致证券交易系统非正常运行甚至瘫痪，可能导致您的交易委托无法成交或无法全部成交，并可能给您造成经济损失。

特别提示：由上述可见，债券投资存在着一定的风险，您在进行债券交易时存在盈利的可能，也存在亏损的风险。本公司敬告投资者，应当根据自身的经济实力和心理承受能力认真制定债券交易策略，您务必对此有清醒的认识，认真考虑是否进行债券交易。您应理解并始终牢记证券投资的“买者自负”原则，防止不顾一切的、盲目投资的非理性行为。在您作出投资决策后，所有投资风险由您自行承担。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明债券交易的所有风险。您在参与债券交易前，应认真阅读债券上市说明书以及交易所相关业务规则，并做好风险评估与财务安排，确定自身有足够的风险承受能力，避免因参与债券交易而遭受难以承受的损失。

关于本次风险揭示，如您有任何问题，请联系您的专属销售/投资经理或拨打股票业务部客服热线（4008209068），我们将一如既往竭诚为您服务！

特此公告。

中国国际金融股份有限公司

二零二二年五月二十三日