

中国国际金融股份有限公司关于交易型开放式基金纳入互联互通的公告

尊敬的投资者：

2022年6月24日，中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布《关于交易型开放式基金纳入互联互通相关安排的公告》，同日上海证券交易所和深圳证券交易所（简称“沪深交易所”）发布最新修订的《上海证券交易所沪港通业务实施办法（2022年修订）》《深圳证券交易所深港通业务实施办法（2022年修订）》及相关通知（以下统称“通知”）。中国证监会和香港证券及期货事务监察委员会于2022年6月28日发布联合公告正式批准两地交易所将符合条件的交易型开放式基金纳入内地与香港股票市场互联互通机制，自7月4日起启动交易。根据沪深交易所要求，中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）对照更新了投资者开通港股通交易权限必须签署的港股通委托交易协议和风险揭示书，对于通知发布前已经开通港股通交易权限的投资者，中金公司现就主要修订内容进行公告，具体如下：

- 1、对于交易委托协议和风险揭示书，参照沪深交易所规定对于同时适用于股票、股票ETF的规定，视条款内容相应地将“股票”表述调整为“证券”或“标的证券”；
- 2、对于风险揭示书，增加港股通ETF价格波动较大产生的风险。新增“港股通ETF可能出现因跟踪标的指数成份证券大幅波动、

流动性不佳、受有关场外结构化产品影响、交易异常情形等原因而引起价格较大波动、折溢价率和跟踪误差偏离合理区间等情形，尤其是考虑到香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）市场股票及 ETF 交易不设置涨跌幅限制，您应关注可能产生的风险。”

3、对于风险揭示书，增加港股通 ETF 在基金管理人变更和终止上市情形下的风险提示。新增“港股通 ETF 可能因基金管理人主动退出香港市场导致终止上市或更换基金管理人的风险。提示您注意，与内地证券市场相比，香港市场 ETF 终止上市或更换基金管理人等制度安排存在一定差异，港股通 ETF 可能因基金管理人主动退出香港市场导致终止上市或更换基金管理人，您应当关注可能产生的风险。”

4、对于风险揭示书，增加港股通 ETF 在清盘情形下的风险提示。新增“港股通 ETF 清盘业务的风险。提示您注意，与内地证券市场相比，香港市场 ETF 发生清盘业务，将基金资产变现所得的资金派发给投资者后，投资者证券账户中相应基金份额的注销日与清盘资金发放日之间可能间隔较长时间，对清盘后尚未注销的基金份额，您应审慎评估其价值。”

5、对于风险揭示书，补充港股通 ETF 在分拆合并、交易单位变更下产生碎股的风险；新增“股份分拆合并产生碎股的风险。提示您注意，港股通股票、港股通有并行买卖的 ETF 实施分拆合并期间，您持有的该证券只在临时代码单柜交易末日、临时代码与新

代码并行交易末日由临时代码转换为新代码。由于临时代码与原代码交易单位不同而可能产生碎股，您应关注可能产生的风险。”

和“证券变更交易单位产生碎股的风险。提示您注意，港股通股票、港股通有并行买卖的 ETF 变更交易单位时，在实施原代码和临时代码并行交易期间，根据有关港股通标的证券在境内的登记结算安排，港股通业务仅提供原代码的交易服务，暂不提供临时代码交易服务。由于临时代码与原代码交易单位不同而可能产生碎股，您应关注可能产生的风险。”

6、对于风险揭示书，明确投资者现阶段不能通过港股通参加港股通 ETF 发行认购和申购赎回。新增“公司行为受限产生的风险。提示您注意，您通过港股通业务暂不能参与新股发行认购、超额供股和超额公开配售，以及 ETF 发行认购和申购赎回。”

7、对于风险揭示书，补充港股通 ETF 收益分派较香港市场延后等内容。新增“现金红利发放较香港市场延后产生的风险。提示您注意，对于在联交所上市公司派发的现金红利或联交所上市 ETF 进行的收益分配，由于中国结算需要在收到香港结算派发的外币红利资金后进行换汇、清算、发放等业务处理，您通过港股通业务获得的现金红利将会较香港市场有所延后。”

关于本次港股通交易委托协议和风险揭示书内容修订，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

二零二二年七月四日