

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 （A 类份额）基金产品资料概要

编制日期：2020 年 8 月 21 日

送出日期：2020 年 8 月 28 日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

一、产品概况

基金简称	南方小康 A	基金代码	202021
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2010 年 8 月 27 日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式		
开放频率	每个开放日		
基金经理	龚涛	开始担任本基金基金经理的日期	2019 年 7 月 12 日
		证券从业日期	2008 年 2 月 11 日
基金经理	崔蕾	开始担任本基金基金经理的日期	2019 年 7 月 12 日
		证券从业日期	2015 年 2 月 2 日

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

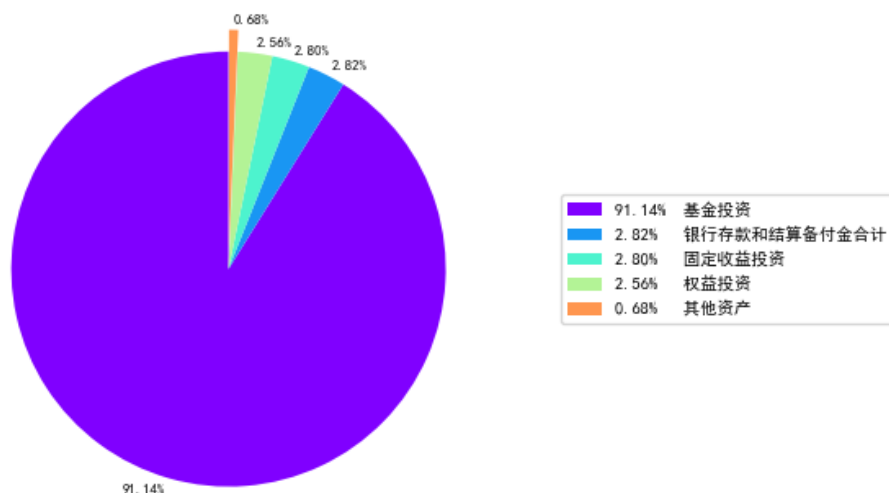
详见《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	通过投资于小康 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金标的指数为中证南方小康产业指数。 本基金主要投资于小康 ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于小康 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。待其他衍生金融产品推出以后，基金管理人可以在控制风险的前提下运用衍生金融产品进行投资。

主要投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以小康 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资小康 ETF。本基金并不参与小康 ETF 的管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于小康 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金标的指数为中证南方小康产业指数。 本基金业绩比较基准为中证南方小康产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

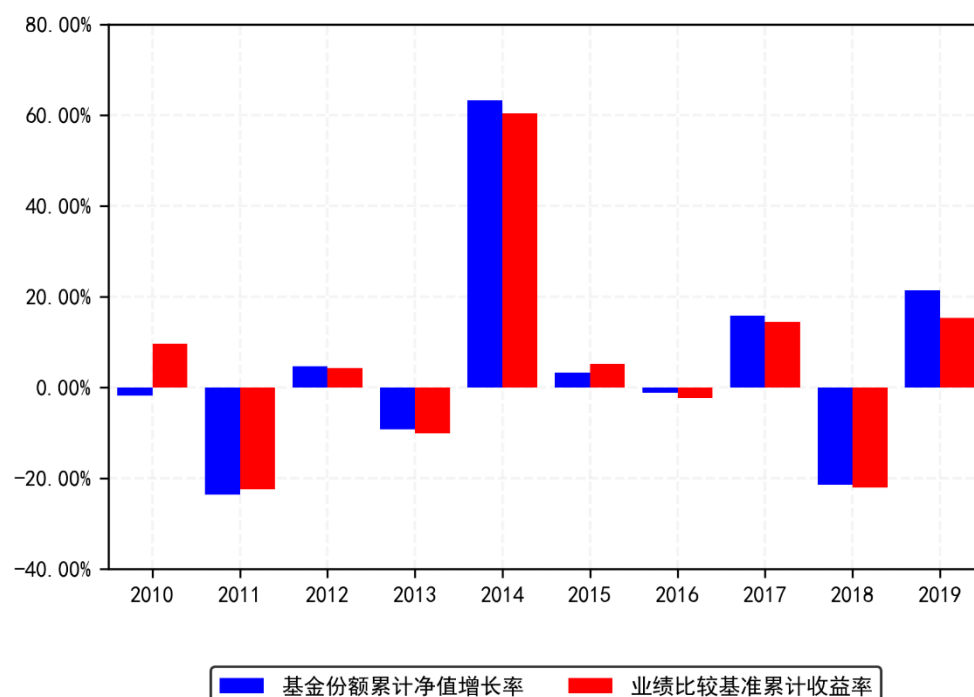
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2020年6月30日）



（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

南方小康A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2019年12月31日）



1. 基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度进行折算。
2. 基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
认购费	M < 100 万元	1% 前收费	
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.6% 前收费	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.3% 前收费	
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	前收费
认购费	N < 365 天	1.2% 后收费	
	1 年 ≤ N < 2 年	1% 后收费	
	2 年 ≤ N < 3 年	0.8% 后收费	
	3 年 ≤ N < 4 年	0.6% 后收费	
	4 年 ≤ N < 5 年	0.3% 后收费	
	5 年 ≤ N	0% 后收费	
申购费（前收费）	M < 100 万元	1.2%	-
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.8%	-
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%	-

	万元		
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	-
	N < 365 天	1.4%	-
	1 年 ≤ N < 2 年	1.2%	-
	2 年 ≤ N < 3 年	1%	-
	3 年 ≤ N < 4 年	0.8%	-
	4 年 ≤ N < 5 年	0.4%	-
	5 年 ≤ N	0%	-
	N < 7 天	1.5%	-
	7 天 ≤ N < 365 天	0.5%	-
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%	-
	2 年 ≤ N	0%	-

注：投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（二）基金运作相关费用

费用类别	收费方式	年费率
管理费	-	0.50%
托管费	-	0.10%
销售服务费	-	-
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、指数使用费、基金的银行汇划费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

本基金的计费基础为扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有风险

（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

由于基金投资过程中的证券交易成本、基金管理费和托管费的存在以及其它因素，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（4）投资于目标 ETF 基金带来的风险

由于主要投资于小康 ETF，所以本基金会面临诸如小康 ETF 的管理风险与操作风险、小康 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、小康 ETF 的技术风险等风险。

2、本基金投资股指期货的风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

- （1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

3、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

- （1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）上市公司经营风险；（5）购买力风险。

4、管理风险

（1）在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

（2）基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

5、流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于国内股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

- （1）本基金的申购、赎回安排
- （2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估
- （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施
- （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按基金合同约定的时限支付赎回款项。

6、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和代销机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，

不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

7、其他风险

如因技术因素、人为因素、战争、自然灾害等因素而产生的风险等。

（二）重要提示

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2010 年 6 月 30 日证监许可[2010]892 号文核准募集。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地点为北京市。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.nffund.com][客服电话：400-889-8899]

- 《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、
- 《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议》、
- 《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金招募说明书》
- 定期报告、包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

六、其他情况说明

暂无。