

# 南方沪深300指数增强型证券投资基金（C类份额）

## 基金产品资料概要

更新日期：2020年3月11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	南方沪深300增强C	基金代码	009060
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	-	交易币种	人民币
基金类型	股票型	开放频率	每个开放日
运作方式	普通开放式		
基金经理	李振兴	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2008年6月24日
其他	《基金合同》生效后，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。		

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，立足价值投资理念深入研究筛选，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过主动投资基本面优秀、估值合理的个股的方式实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到

	期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	1、指数复制策略；2、以增强指数投资收益为目的的主动选股投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货和股票期权等投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

注：详见《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表 无

(三) 自基金合同生效以来 / 最近十年 (孰短) 基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图 无

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率	备注
认购费	-	0.00%	本基金 C 类份额无认购费
申购费 (前收费)	-	0.00%	本基金 C 类份额无申购费
赎回费	N < 7 日	1.5%	
	7 日 ≤ N < 30 日	0.75%	
	N ≥ 30 日	0.00%	

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。

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.5%
托管费	0.1%
销售服务费	0.4%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，指数使用许可费，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/期货交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户及维护费用，因参与转融通证券出借业务而产生的各项合理费用，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：本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 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、本基金为增强型股票指数基金，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。因此，境内的股票市场和债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

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标的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）杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

（6）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（7）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、本基金投资资产支持证券的风险。

本基金可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险和操作风险。本基金管理人将通过内部信用评级、投资授信控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。同时，本基金管理人将对资产支持证券进行全程合规监控，通过事前控制、事中监督和事后报告检查等方式，确保资产支持证券投资的合法合规。

4、本基金投资流通受限证券的风险。

本基金可投资于流通受限证券，因此可能面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险，同时由于流通受限证券的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定期限内无法流通，在面临基金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。目前，本基金管理人已建立了健全的内部控制体系，全面监控流动性受限证券的种类、投资比例、内部审批流程、信息披露、日常风险监控等环节，做好危机处理预案，确保流通受限证券投资的合法合规。

5、本基金参与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在

转融通业务特有风险，包括但不限于以下风险：

(1) 流动性风险

面对大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现、支付赎回款项的风险；

(2) 信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；

(3) 市场风险

证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的风险。

(4) 操作风险

由于不完善或有问题的内部操作流程、人员违规或失误、系统故障或外部事件所导致的直接或间接损失的风险

除上述风险外，本公司参与转融通证券出借业务还应关注外部监管机构或公司要求关注的其他风险。

## (二) 重要提示

南方沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2019年9月24日证监许可[2019]1755号文注册募集。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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见南方基金官方网站 [www.nffund.com] [客服电话：400-889-8899]

- 《南方沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、  
《南方沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》、  
《南方沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 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