

南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020 年 8 月 21 日

送出日期：2020 年 8 月 26 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 300ETF	基金代码	159925
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	2013 年 2 月 18 日	上市交易所	深圳证券交易所
		上市日期	2013 年 4 月 11 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	交易型开放式		
开放频率	每个开放日		
基金经理	罗文杰	开始担任本基金基金经理的日期	2013 年 5 月 17 日
		证券从业日期	2005 年 5 月 1 日
其他	场内简称：南方 300		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

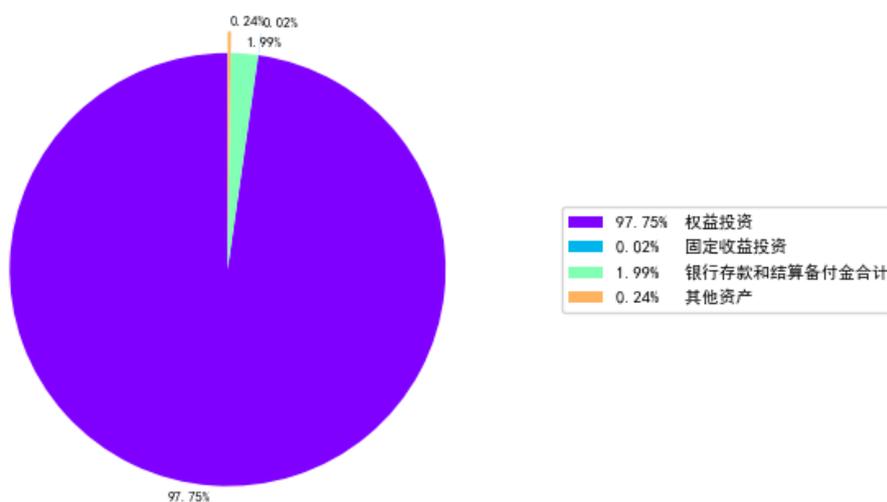
详见《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	<p>本基金标的指数为沪深 300 指数。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股、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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，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。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>

<p>主要投资策略</p>	<p>本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 指数。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，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。</p>

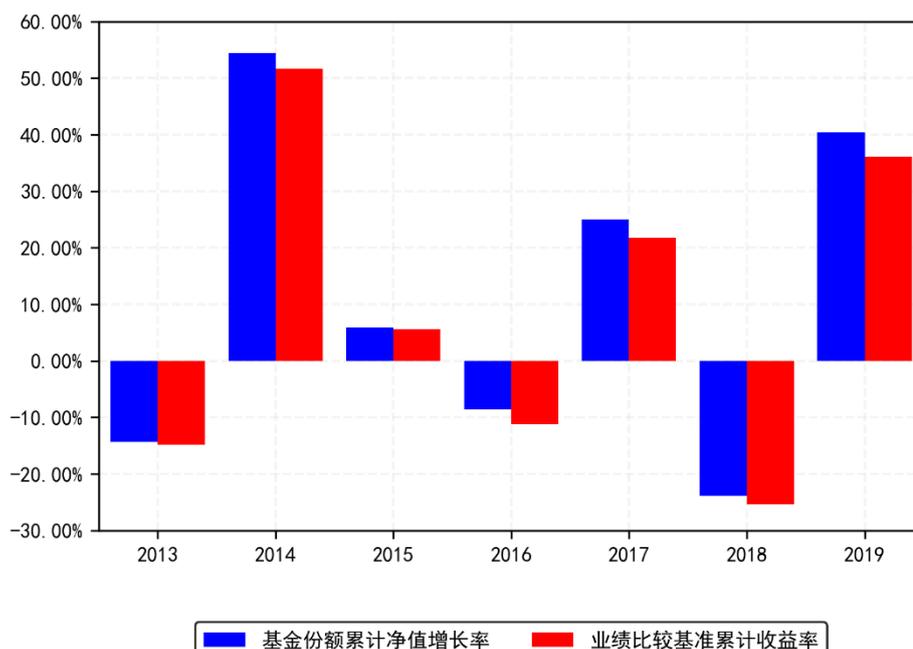
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

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

南方沪深300ETF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
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1%	集中申购费
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.6%	集中申购费
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.3%	集中申购费
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	集中申购费

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

基金管理人办理网下现金集中申购按照上表所示费率收取集中申购费用。基金管理人办理网下股票、发售代理机构办理网上现金和网下股票集中申购时可参照上述费率结构，按照不高于 1.0% 的标准收取一定的佣金。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

投资者在申购基金份额时，申购代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金。

投资者在赎回基金份额时，赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金。

（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；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；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；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。	

本基金指数使用费为 0.03%。

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。

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。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险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、投资股指期货的风险及其他风险等。

本基金交易方式带来的流动性风险：

（1）本基金最小申购、赎回单位设置较高（目前为 200 万份），中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

（2）基金在深圳证券交易所上市交易，但不保证市场交易一定活跃；基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

（3）尽管由于投资者可以进行申购、赎回，基金一般不会持续出现大幅折溢价情况。但是，基金的二级市场交易价格受市场供求的影响，可能高于（称为溢价）或低于（称为折价）基金份额净值。

本基金特有的风险包括：

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

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

5、IOPV 计算错误的风险

证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担后果。

6、投资者赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。

7、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

8、原开元基金的份额折算风险

本基金是由开元证券投资基金转型而来的交易型开放式基金，将按照 1.00 元初始面值开展集中申购，在集中申购期结束后将进行基金份额折算。集中申购将采用网上现金、网下现金和网下股票三种方式，在集中申购资金和股票划入本基金资产后，可能改变本基金的投资组合。另一方面，由于集中申购资金验资、划转等因素，使得集中申购资金和股票划入本基金资产的日期与份额折算基准日不同，导致基金投资组合和风险收益特征在此期间发生变化的风险。

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。

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：

本基金为交易型开放式基金，将依据市场最新流动性情况，在申购赎回清单中设定适当的每日赎回上限，以尽量规避巨额赎回导致的流动性风险。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，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人将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。实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。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对价。

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。

(二) 重要提示

南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金由开元证券投资基金（经中国证监会证监基金字【1998】6 号文批准）转型为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金后，再由南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更名而来。基金转型经 2013 年 1 月 4 日开元证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2013 年 1 月 25 日证监许可 [2013] 61 号文核准。自 2013 年 2 月 18 日起，由《开元证券投资基金基金合同》修订而成的《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，原《开元证券投资基金基金合同》同日起失效。自 2019 年 4 月 23 日起，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金名称变更为“南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”。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]

- 《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、
- 《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》、
- 《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资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。