

南方基金关于调整公司旗下公募基金风险评级相关事项的公告

根据《证券期货投资者适当性管理办法》和《基金募集机构投资者适当性管理实施指引(试行)》，为进一步提升投资者适当性服务水平，南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）决定自2020年12月21日起调整公司旗下公募基金风险评级的方式以及其他相关事项。现将有关事项公告如下：

一、 适用基金及业务范围

调整公司旗下所有公募基金的风险评级方式和标准，风险评级方式和标准调整后相应调整部分基金的风险等级，调整后的基金风险等级详见公司官网。本次调整事项适用于公司直销渠道以及采用公司产品风险评级方式、标准和结果的销售机构。

二、 重要提示

1、本次调整后，公司公募基金的风险评级方式将由参考第三方评级（海通证券股份有限公司）调整为公司自评。

2、调整后的《南方基金公募产品风险评级方法概述》详见本公告附件和公司官网。

3、此次公司公募基金风险评级方式和规则调整后，部分基金的风险等级将发生变化，请投资人务必了解调整后的基金风险等级，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否与本人的风险承受能力及投资需求相适应。

4、公司履行基金风险等级评估等适当性职责，并不能取代投资人自己的投资判断，也不会降低基金的固有风险。同时，与基金相关的投资风险以及费用等将由投资人自行承担。基金有风险，投资需谨慎，请投资人在做出投资决策前详阅基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件以及基金公告，了解基金具体情况。

三、 其他事项：

如有疑问，投资人可通过以下途径了解或咨询相关情况：

南方基金客服电话：400-889-8899

南方基金网址：www.nffund.com

特此公告。

附件：南方基金公募产品风险评级方法概述

南方基金管理股份有限公司

2020年12月18日

附件：

南方基金公募产品风险评级方法概述

按照《证券期货投资者适当性管理办法》以及《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》的规定，南方基金制定本公司基金产品风险评级方法，对本公司基金产品进行风险等级划分。

本公司基金产品风险评级分为五类，高风险（R5），中高风险（R4），中风险（R3），中低风险（R2），低风险（R1）。

风险评级采用定量与定性相结合的方式。定量指标分为基金产品合同风险评分和存续期风险评分两部分。基金产品合同风险评分主要依据基金合同中的投资品种和投资范围等因素进行分类评分。存续期风险评分参考的投资指标主要包括：标准差、贝塔值、风险资产净仓位、重仓证券集中度、杠杆比例、运作方式（产品流动性）等。综合加权基金产品合同风险评分与存续期风险评分，得出定量得分。之后综合考虑产品、基金管理人及市场情况等各项因素，挖掘产品运作过程中可能存在的风险，对产品的定量得分进行定性调整，形成最终得分，完成对基金风险的评级。

如以上定量指标不适用于某只或某类基金产品，或基金产品性质发生重大变化，可能对投资者产生较大影响时，我们将考虑使用特定方法审慎评价基金的风险等级。

对于新成立的基金，募集时确定初始风险评级。对于存续期基金，定期对风险评级结果进行跟踪评估。

本公司可根据实际情况的变更不定期地对公募产品风险评级方法作出修订。

本规则的解释权在法律法规允许的范围内归本公司所有。