

# 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金产品 资料概要更新

编制日期：2021年10月14日

送出日期：2021年10月15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ETF           | 基金代码           | 510160       |
| 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        | 上市交易所          | 上海证券交易所      |
|         |                   | 上市日期           | 2010年11月1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   |
| 其他      | 场内简称：产业升级；产业升级ETF |                |              |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

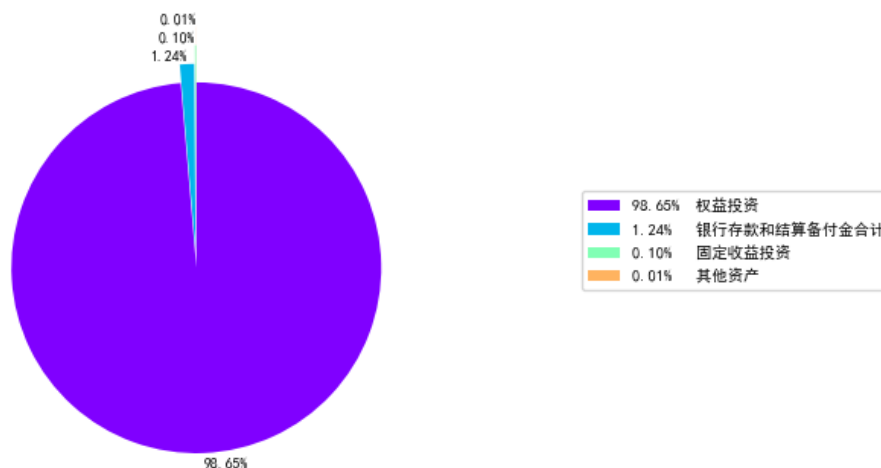
详见《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

|        |  |
|--------|--|
| 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、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。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>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。</p> <p>本基金可投资存托凭证。</p> <p>本基金的标的指数为中证南方小康产业指数，简称小康指数。</p> |
| 主要投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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   |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>其权重的变化进行相应调整。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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>   |
| 业绩比较基准 | <p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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。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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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> |
| 风险收益特征 | <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，主要采用完全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>  |

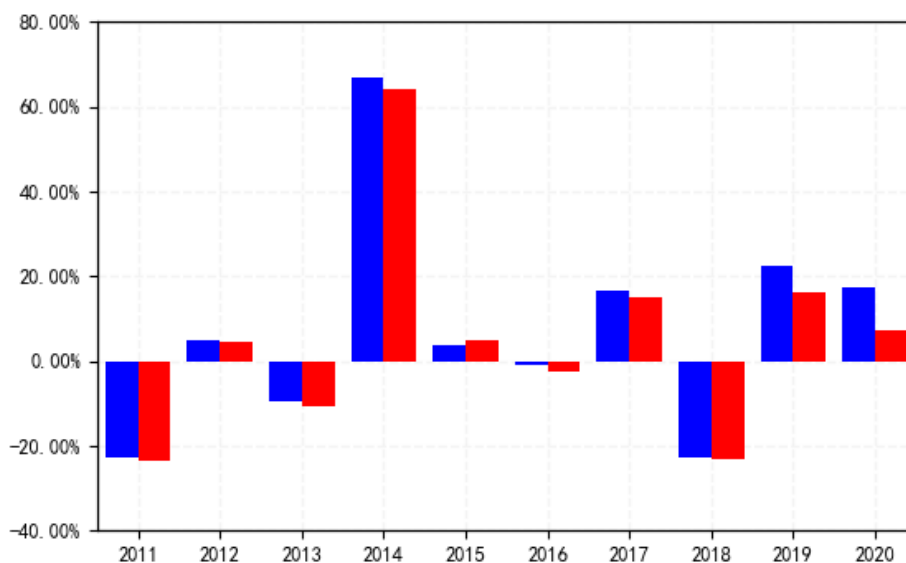
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图 (2021年6月30日)



(三) 最近十年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ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2020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%        | -  |
|      | 100 万元 ≤ M < 300 万元       | 0.6%      | -  |
|      | 300 万元 ≤ M < 500 万元       | 0.3%      | -  |
|      | 500 万元 ≤ M                | 每笔 1000 元 | -  |

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

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

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，基金上市费及年费，基金收益分配中发生的费用，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，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：指数使用费：0.03%。

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。

当本基金的季度日均基金资产净值(季度日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数)大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。

#### 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。投资者可能损失投资本金。

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。

##### 一、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。

##### 二、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。

##### 三、流动性风险

指由于相关成份股的市场流动性不足使基金无法以合理价格买入或卖出所需股份数量所造成的风险。对 ETF 基金而言，流动性风险主要发生在基金建仓期以及标的指数调整成份股期间。

##### (1) 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基金在上海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。

##### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在证监会及相关法律法规规定的合法范围之内，且一般具备良好的市场流动性和可投资性。本基金投资范围的设定也合理、明确，操作性较强。本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，可少量投资于非成份股，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，以上均为基金平稳运作提供了良好的基础。根据

《流动性风险规定》的相关要求，本基金将审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

### (3) 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。

## 四、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及跟踪误差控制未达约定目标的风险

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

证券交易所计算并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、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭

证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 9、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

(2) 登记机构可能调整结算制度，对投资者基金份额、资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券/期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### (4) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。投资者将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 10、成份股停牌、摘牌的风险

标的指数的当前成份股可能会改变、停牌或摘牌，此后也可能会有其它股票加入成为该指数的成份股。本基金投资组合与相关指数成份股之间并非完全相关，在标的指数的成份股调整时，存在由于成份股停牌或流动性差等原因无法及时买卖成份股，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。当标的指数的成份股摘牌时，本基金可能无法及时卖出而导致基金净值下降，跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响，当基金管理人对该成份股予以调整时也可能产生跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

#### 五、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。

#### 六、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

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金（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核准，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。

投资人知悉并同意基金管理人可为投资人提供营销信息、资讯与增值服务，并可自主选择退订，具体的服务说明详见招募说明书“基金份额持有人服务”章节。

## 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。